

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

運用報告書（全体版） 第37期

（決算日 2024年 8月19日）

（作成対象期間 2023年 8月18日～2024年 8月19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。

当ファンドは、わが国の株式に投資し、信託財産の成長をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、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。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
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）
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

★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（設定日：1987年 8月22日）		
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	
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。		

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			日経平均トータルリターン・インデックス		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			
33期末(2020年8月17日)	円 7,400	円 5	% 12.8	37,864.53	% 14.7	% 98.2	% 1.8	百万円 16,727
34期末(2021年8月17日)	8,779	5	18.7	45,697.65	20.7	96.0	3.9	16,379
35期末(2022年8月17日)	9,407	5	7.2	49,655.84	8.7	98.3	1.6	16,633
36期末(2023年8月17日)	10,357	5	10.2	54,959.11	10.7	93.9	6.0	16,591
37期末(2024年8月19日)	12,397	5	19.7	66,176.59	20.4	93.6	6.3	17,950

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注3) 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。

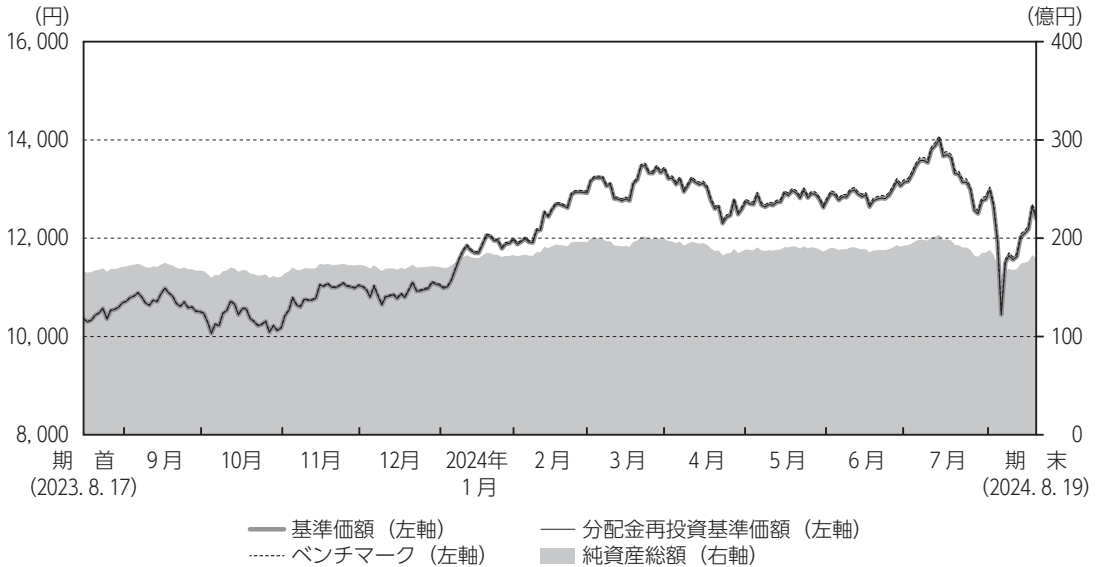
(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

「日経平均トータルリターン・インデックス」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「日経平均トータルリターン・インデックス」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。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

- * 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に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。
- * 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（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- * ベンチマークは日経平均トータルリターン・インデックスです。

■ 基準価額・騰落率

期 首：10,357円

期 末：12,397円（分配金5円）

騰落率：19.7%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

ベンチマークへの連動をめざした運用を行った結果、ベンチマークの動きを反映して、基準価額は上昇しました。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 ト ー タ ル リ タ ー ン ・ イ ン デ ッ ク ス		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) 2023年 8月17日	円 10,357	% —	54,959.11	% —	% 93.9	% 6.0
8月末	10,685	3.2	56,720.29	3.2	94.0	5.8
9月末	10,505	1.4	55,787.13	1.5	95.6	4.1
10月末	10,173	△ 1.8	54,040.84	△ 1.7	96.2	3.6
11月末	11,035	6.5	58,651.09	6.7	97.0	2.9
12月末	11,042	6.6	58,704.41	6.8	98.2	1.5
2024年 1月末	11,967	15.5	63,659.32	15.8	99.3	0.6
2月末	12,922	24.8	68,747.00	25.1	94.2	5.5
3月末	13,399	29.4	71,346.41	29.8	97.0	2.8
4月末	12,745	23.1	67,877.75	23.5	97.7	2.2
5月末	12,770	23.3	68,023.40	23.8	98.2	1.6
6月末	13,141	26.9	70,056.40	27.5	98.7	1.2
7月末	12,978	25.3	69,208.61	25.9	93.4	6.3
(期末) 2024年 8月19日	12,402	19.7	66,176.59	20.4	93.6	6.3

(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

(2023. 8. 18 ~ 2024. 8. 19)

国内株式市況

国内株式市況は大幅に上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、2023年8月半ばに発表された4－6月期のGDP（国内総生産）成長率が市場予想を上回る高い伸びとなったことなどが好感されて上昇する局面もありましたが、米国における長期金利の上昇や景気の先行き不透明感、パレスチナ情勢の悪化などが懸念され、保ち合い相場が継続しました。11月以降も、欧米の金利低下や良好な企業決算、株主還元拡充の発表などが好感された一方で円高進行などが懸念され、狭いレンジでの推移となりました。しかし2024年1月以降は、新NISA（少額投資非課税制度）を通じた資金流入や海外投資家による日本株投資の積極化、円安進行などが好感され、急上昇しました。3月下旬以降は、急ピッチでの上昇が一服し、景況感の悪化や市場予想を下回る企業業績見通しの発表、国内長期金利の上昇、国内外の政治情勢の不透明感などが上値を抑え、高値圏での保ち合いとなりました。6月下旬以降は、海外のAI（人工知能）関連企業の株価急騰や円安進行などが好感されて上昇しましたが、7月中旬以降は、半導体関連企業への対中輸出規制強化の報道や円高進行などが嫌気され、反落しました。8月に入ると、米国の景気悪化懸念で円高が進行したことなどを受けて急落する局面も見られたものの、米ISM（米国供給管理協会）非製造業景況感指数が市場予想比で上振れし、過度な悲観が後退したことや、日銀副総裁による市場に配慮した発言などを受け、反発して当作成期末を迎えました。

前作成期末における「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います。

ミリオン・インデックスマザーファンド

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。

ポートフォリオについて

(2023. 8. 18 ~ 2024. 8. 19)

■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いました。

■ミリオン・インデックスマザーファンド

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

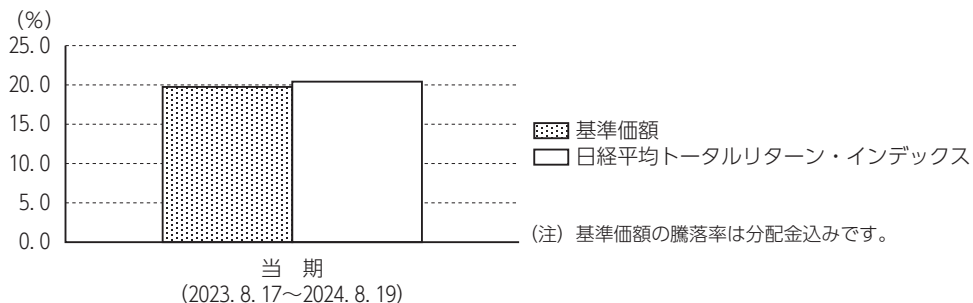
組入ファンド	ベンチマーク
ミリオン・インデックスマザーファンド	日経平均トータルリターン・インデックス

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は20.4%の上昇となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は19.7%の上昇となりました。

運用管理費用、マザー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ベンチマークの騰落率との差異、先物取引の影響等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。



* ベンチマークは日経平均トータルリターン・インデックスです。

分配金について

当作成期の1万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（1万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「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	
	2023年8月18日 ～2024年8月19日	
当期分配金（税込み）	（円）	5
対基準価額比率	（％）	0.04
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）	8,631

- （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。
- （注4）投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。

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	2,032.82
(c) 収益調整金	✓ 1,997.42
(d) 分配準備積立金	4,606.31
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	8,636.57
(f) 分配金	5.00
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	8,631.57

- （注）✓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います。

ミリオン・インデックスマザーファンド

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2023. 8. 18~2024. 8. 19)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	57円	0.481%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は11,939円です。
(投 信 会 社)	(25)	(0.210)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(26)	(0.221)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、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 会 社)	(6)	(0.050)	受託会社分は、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	0.001	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 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・オプション)	(0)	(0.001)	
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成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	1	0.005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(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	58	0.487	

(注1) 当作成期中の費用（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。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

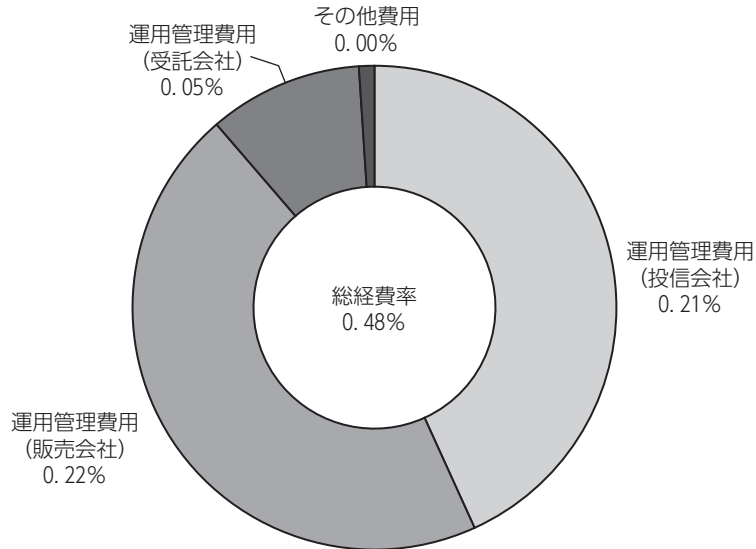
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該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。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・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口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.48%です。



(注1) 1万口当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。

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

■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

(2023年8月18日から2024年8月19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	—	—	859,036	1,959,100

(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

(2023年8月18日から2024年8月19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	3,092,949千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	17,883,986千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.17

(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等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成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当作成期中の利害関係人との取引状況

(2023年8月18日から2024年8月19日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B		売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	
百万円		百万円	%		百万円	百万円
株式	686	54	8.0	2,406	2	0.1
株式先物取引	5,255	—	—	5,154	—	—
コール・ローン	336,109	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合98.1%

※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

(2023年8月18日から2024年8月19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	当作成期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	—	2	20

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 当作成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

当作成期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

※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、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券株式会社、株式会社大和証券グループ本社、あおぞら銀行です。

■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	8,513,506	7,654,470	17,946,670

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年8月19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	17,946,670	99.6
コール・ローン等、その他	65,849	0.4
投資信託財産総額	18,012,520	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

2024年8月19日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	18,012,520,082円
コール・ローン等	56,449,388
ミリオン・インデックス マザーファンド（評価額）	17,946,670,694
未収入金	9,400,000
(B) 負債	61,738,735
未払収益分配金	7,240,151
未払解約金	8,704,113
未払信託報酬	45,268,427
その他未払費用	526,044
(C) 純資産総額（A－B）	17,950,781,347
元本	14,480,302,334
次期繰越損益金	3,470,479,013
(D) 受益権総口数	14,480,302,334口
1万口当り基準価額（C／D）	12,397円

* 期首における元本額は16,019,819,389円、当作成期間中における追加設定元本額は132,016,992円、同解約元本額は1,671,534,047円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,397円です。

■損益の状況

当期 自 2023年8月18日 至 2024年8月19日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	13,285円
受取利息	15,552
支払利息	△ 2,267
(B) 有価証券売買損益	3,031,722,181
売買益	3,311,194,267
売買損	△ 279,472,086
(C) 信託報酬等	△ 88,121,848
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	2,943,613,618
(E) 前期繰越損益金	6,670,072,092
(F) 追加信託差損益金	△ 6,135,966,546
（配当等相当額）	（ 2,892,335,702）
（売買損益相当額）	（△ 9,028,302,248）
(G) 合計（D＋E＋F）	3,477,719,164
(H) 収益分配金	△ 7,240,151
次期繰越損益金（G＋H）	3,470,479,013
追加信託差損益金	△ 6,143,206,697
（配当等相当額）	（ 2,885,095,551）
（売買損益相当額）	（△ 9,028,302,248）
分配準備積立金	9,613,685,710

（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下記「収益分配金の計算過程（総額）」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	13,285円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	2,943,589,929
(c) 収益調整金	2,892,335,702
(d) 分配準備積立金	6,670,082,496
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	12,506,021,412
(f) 分配金	7,240,151
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	12,498,781,261
(h) 受益権総口数	14,480,302,334口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)	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20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19日現在の基準価額に基づいて行いました。

- ・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。

ミリオン・インデックスマザーファンド

運用報告書 第37期 (決算日 2024年8月19日)

(作成対象期間 2023年8月18日～2024年8月19日)

ミリオン・インデックスマザーファンド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。

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、日経平均トータルリターン・インデックス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
株式組入制限	無制限

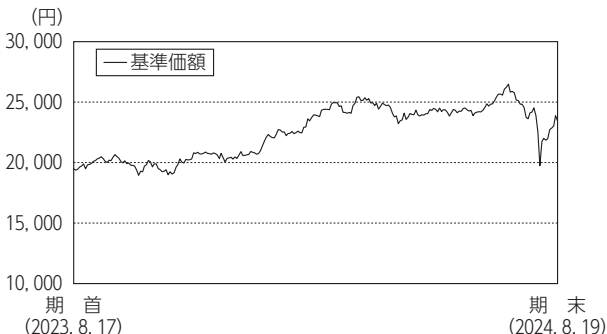
大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		日経平均トータルリターン・インデックス (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率
	円	騰落率 %		騰落率 %	%	%
(期首) 2023年8月17日	19,487	—	54,959.11	—	93.9	6.0
8月末	20,108	3.2	56,720.29	3.2	94.1	5.8
9月末	19,777	1.5	55,787.13	1.5	95.6	4.1
10月末	19,159	△ 1.7	54,040.84	△ 1.7	96.2	3.6
11月末	20,792	6.7	58,651.09	6.7	97.1	2.9
12月末	20,811	6.8	58,704.41	6.8	98.3	1.5
2024年1月末	22,565	15.8	63,659.32	15.8	99.3	0.6
2月末	24,376	25.1	68,747.00	25.1	94.3	5.5
3月末	25,286	29.8	71,346.41	29.8	97.0	2.8
4月末	24,061	23.5	67,877.75	23.5	97.7	2.2
5月末	24,119	23.8	68,023.40	23.8	98.2	1.6
6月末	24,829	27.4	70,056.40	27.5	98.7	1.2
7月末	24,531	25.9	69,208.61	25.9	93.5	6.3
(期末) 2024年8月19日	23,446	20.3	66,176.59	20.4	93.7	6.3

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《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：19,487円 期末：23,446円 騰落率：20.3%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークへの運動をめざした運用を行った結果、ベンチマークの動きを反映して、基準価額は上昇しました。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

国内株式市況は大幅に上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、2023年8月半ばに発表された4～6月期のGDP（国内総生産）成長率が市場予想を上回る高い伸びとなったことなどが好感されて上昇する局面もありましたが、米国における長期金利の上昇や景気の先行き不透明感、パレスチナ情勢の悪化などが懸念され、保ち合い相場が継続しました。11月以降も、欧米の金利低下や良好な企業決算、株主還元拡充の発表などが好感された一方で円高進行などが懸念され、狭いレンジでの推移となりました。しかし2024年1月以降は、新NISA（少額投資非課税制度）を通じた資金流入や海外投資家による日本株投資の積極化、円安進行などが好感され、急上昇しました。3月下旬以降は、急ピッチでの上昇が一服し、景況感の悪化や市場予想を下回る企業業績見通しの発表、国内長期金利の上昇、国内外の政治情勢の不透明感などが上値を抑え、高値圏での保ち合いとなりました。6月下旬以降は、海外のAI（人工知能）関連企業の株価急騰や円安進行などが好感されて上昇しましたが、7月中旬以降は、半導体関連企業への対中輸出規制強化の報道や円高進行などが嫌気され、反落しました。8月に入ると、米国の景況感悪化懸念で円高が進行したことを受けて急落する局面も見られたものの、米ISM（米国供給管理協会）非製造業景況感指数が市場予想比で上振れし、過度な悲観が後退したことや、日銀副総裁による市場に配慮した発言などを受け、反発して当作成期末を迎えました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。

◆ポートフォリオについて

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は20.4%の上昇となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は20.3%の上昇となりました。

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ベンチマークの騰落率との差異、先物取引の影響等が乖離の要因として挙げられます。

※ベンチマークは日経平均トータルリターン・インデックスです。

《今後の運用方針》

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。

■ 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・オプション)	0円 (0) (0)
有価証券取引税	—
その他費用	—
合 計	0

(注 1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。

(注 2) 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

(2023年 8 月18日から2024年 8 月19日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 67.3 (862.1)	千円 686,169 (ー)	千株 556.7	千円 2,406,780

(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) 先物取引の種類別取引状況

(2023年 8 月18日から2024年 8 月19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	百万円 5,255	百万円 5,154	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

(2023年 8 月18日から2024年 8 月19日まで)

銘 柄	当 期			銘 柄	期 付		
	株 数	金 額	平均単価		株 数	金 額	平均単価
ディスコ	千株 3.2	千円 183,264	円 57,270	ファーストリテイリング	千株 6	千円 249,017	円 41,502
ニトリホールディングス	8.3	160,815	19,375	東京エレクトロン	6	197,726	32,954
レーザーテック	6.8	158,248	23,271	ソフトバンクグループ	12	109,673	9,139
ソシオネクスト	16	67,975	4,248	アドバンテスト	16	104,470	6,529
ZOZO	16	61,017	3,813	信越化学	10	63,269	6,326
メルカリ	17	54,847	3,226	KDDI	12	56,545	4,712
				TDK	6	56,372	9,395
				ダイキン工業	2	46,521	23,260
				リクルートホールディングス	6	46,132	7,688
				ファナック	10	42,832	4,283

(注 1) 金額は受渡し代金。

(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

ミリオン・インデックスマザーファンド

■組入資産明細表

(1) 国内株式

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
水産・農林業 (0.1%)					日東電工	17	15	169,575	千円	日立建機	17	15	52,695	千円
ニッスイ	17	15	12,891		医薬品 (6.5%)					クボタ	17	15	30,270	
鉱業 (0.1%)					協和キリン	17	15	46,320		荏原製作所	3.4	15	29,385	
INPEX	6.8	6	12,966		武田薬品	17	15	64,560		ダイキン工業	17	15	266,625	
建設業 (1.6%)					アステラス製薬	85	75	126,262		日本精工	17	15	11,094	
コムシスホールディングス	17	15	45,360		住友ファーマ	17	15	8,895		NTN	17	15	3,970	
大成建設	3.4	3	18,465		塩野義製薬	17	15	97,410		ジェイテクト	17	15	14,641	
大林組	17	15	28,050		中外製薬	51	45	305,370		三井E&S	1.7	—	—	
清水建設	17	15	13,582		エーザイ	17	15	88,170		日立造船	3.4	3	2,760	
長谷工コーポレーション	3.4	3	5,238		第一三共	51	45	259,470		三菱重工業	1.7	15	28,140	
鹿島建設	8.5	7.5	19,432		大塚ホールディングス	17	15	122,250		IHI	1.7	1.5	8,575	
大和ハウス	17	15	65,520		石油・石炭製品 (0.3%)					電気機器 (26.6%)				
積水ハウス	17	15	52,140		出光興産	6.8	30	32,340		コニカミノルタ	17	15	5,931	
日揮ホールディングス	17	15	19,162		ENEOSホールディングス	17	15	11,274		ミネベアミツミ	17	15	45,930	
食料品 (3.0%)					ゴム製品 (0.6%)					日立	3.4	15	53,250	
日清製粉G本社	17	15	27,885		横浜ゴム	8.5	7.5	24,637		三菱電機	17	15	35,497	
明治ホールディングス	6.8	6	20,502		ブリヂストン	17	15	86,550		富士電機	3.4	3	25,029	
日本ハム	8.5	7.5	39,247		ガラス・土石製品 (0.6%)					安川電機	17	15	69,660	
サッポロホールディングス	3.4	3	21,282		AGC	3.4	3	13,938		ソシオネクスト	—	15	47,790	
アサヒグループホールディング	17	15	79,365		日本板硝子	1.7	—	—		ニデック	13.6	12	73,440	
キリンHD	17	15	31,215		日本電気硝子	5.1	4.5	15,700		オムロン	17	15	79,515	
宝ホールディングス	17	—	—		住友大阪セメント	1.7	—	—		ジーエス・ユアサコーポ	3.4	3	7,953	
キッコーマン	17	75	126,600		太平洋セメント	1.7	1.5	5,259		日本電気	1.7	1.5	18,967	
味の素	17	15	82,650		東海カーボン	17	15	13,210		富士通	1.7	15	37,027	
ニチレイ	8.5	7.5	30,315		TOTO	8.5	7.5	33,960		ルネサスエレクトロニクス	17	15	36,442	
日本たばこ産業	17	15	61,755		日本碍子	17	15	28,575		セイコーエプソン	34	30	77,970	
繊維製品 (0.1%)					鉄鋼 (0.1%)					パナソニックホールディング	17	15	17,137	
帝人	3.4	3	4,035		日本製鉄	1.7	1.5	4,872		シャープ	17	15	13,465	
東レ	17	15	11,277		神戸製鋼所	1.7	1.5	2,604		ソニーグループ	17	15	198,450	
パルプ・紙 (0.1%)					JFEホールディングス	1.7	1.5	2,929		TDK	51	45	442,440	
王子ホールディングス	17	15	8,628		大平洋金属	1.7	—	—		アルプスアルパイン	17	15	22,177	
日本製紙	1.7	1.5	1,369		非鉄金属 (0.9%)					横河電機	17	15	53,625	
化学 (6.5%)					三井金属	1.7	1.5	7,035		アドバンテス	34	120	782,880	
クラレ	17	15	27,592		三菱マテリアル	1.7	1.5	3,890		キーエンス	1.7	1.5	99,435	
旭化成	17	15	15,127		住友鉱山	8.5	7.5	30,795		レーザータック	—	6	173,820	
リゾナック・ホールディング	1.7	1.5	5,259		DOWAホールディングス	3.4	3	14,496		カシオ	17	15	17,100	
住友化学	17	15	6,282		古河電工	1.7	1.5	5,617		ファナック	85	75	305,775	
日産化学	17	15	71,400		住友電工	17	15	35,055		京セラ	34	120	201,720	
東ソー	8.5	7.5	14,066		フジクラ	17	15	59,385		太陽誘電	17	15	55,470	
トクヤマ	3.4	3	8,370		金属製品 (0.0%)					村田製作所	13.6	36	105,930	
デンカ	3.4	3	6,552		SUMCO	1.7	1.5	2,655		SCREENホールディングス	3.4	6	67,860	
信越化学	85	75	463,350		機械 (4.7%)					キヤノン	25.5	22.5	105,840	
三井化学	3.4	3	10,962		日本製鋼所	3.4	3	13,257		リコー	17	15	20,152	
三菱ケミカルグループ	8.5	7.5	6,372		オークマ	3.4	3	18,822		東京エレクトロン	51	45	1,262,475	
UBE	1.7	1.5	3,927		アマダ	17	15	22,620		輸送用機器 (4.2%)				
花王	17	15	95,085		ディスコ	—	3	138,060		デンソー	17	60	135,600	
DIC	1.7	1.5	4,487		SMC	1.7	1.5	98,490		川崎重工業	1.7	1.5	7,452	
富士フイルムHLDGS	17	45	160,470		小松製作所	17	15	62,385		日産自動車	17	15	6,555	
資生堂	17	15	52,200		住友重機械	3.4	3	10,143		いすゞ自動車	8.5	7.5	15,716	

銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株
トヨタ自動車	85	75	199,537	
日野自動車	17	15	6,760	
三菱自動車工業	1.7	1.5	606	
マツダ	3.4	3	3,702	
本田技研	34	90	141,075	
スズキ	17	60	101,190	
SUBARU	17	15	40,582	
ヤマハ発動機	17	45	57,060	
精密機器 (3.8%)				
テルモ	68	120	313,680	
ニコン	17	15	23,212	
オリンパス	68	60	153,900	
H O Y A	8.5	7.5	144,750	
シチズン時計	17	15	13,830	
その他製品 (2.1%)				
パンダイナムコHLDGS	51	45	130,680	
TOPPANホールディングス	8.5	7.5	31,072	
大日本印刷	8.5	7.5	36,877	
ヤマハ	17	15	46,770	
任天堂	17	15	120,990	
電気・ガス業 (0.2%)				
東京電力HD	1.7	1.5	1,031	
中部電力	1.7	1.5	2,627	
関西電力	1.7	1.5	3,688	
東京瓦斯	3.4	3	10,512	
大阪瓦斯	3.4	3	10,017	
陸運業 (0.9%)				
東武鉄道	3.4	3	7,275	
東急	8.5	7.5	12,791	
小田急電鉄	8.5	7.5	11,685	
京王電鉄	3.4	3	10,497	
京成電鉄	8.5	7.5	32,017	
東日本旅客鉄道	1.7	4.5	12,107	
西日本旅客鉄道	1.7	3	8,061	
東海旅客鉄道	1.7	7.5	24,525	
ヤマトホールディングス	17	15	24,007	
NIPPON EXPRESS	1.7	1.5	10,677	
海運業 (0.4%)				
日本郵船	5.1	4.5	22,567	
商船三井	5.1	4.5	22,378	
川崎汽船	5.1	13.5	28,647	
空運業 (0.2%)				
日本航空	17	15	34,575	
ANAホールディングス	1.7	1.5	4,161	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
三菱倉庫	8.5	7.5	35,625	
情報・通信業 (10.5%)				
ネクソン	34	30	88,410	
メルカリ	—	15	30,157	
L I N E ヤフー	6.8	6	2,254	
トレンドマイクロ	17	15	124,365	
日本電信電話	170	150	22,830	

銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株
KDDI	102	90	421,380	
ソフトバンク	17	15	29,100	
東宝	1.7	1.5	7,831	
NTTデータグループ	85	75	153,225	
コナミグループ	17	15	177,900	
ソフトバンクグループ	102	90	744,750	
卸売業 (3.2%)				
双日	1.7	1.5	5,136	
伊藤忠	17	15	107,130	
丸紅	17	15	37,057	
豊田通商	17	45	120,892	
三井物産	17	30	93,360	
住友商事	17	15	50,880	
三菱商事	17	45	136,125	
小売業 (13.9%)				
J.フロントリテイリング	8.5	7.5	11,118	
Z O Z O	—	15	67,425	
三越伊勢丹HD	17	15	35,880	
セブン&アイ・HLDGS	17	45	97,245	
高島屋	8.5	7.5	17,508	
丸井グループ	17	15	35,002	
イオン	17	15	52,725	
ニトリホールディングス	—	7.5	149,887	
ファーストリテイリング	51	45	1,917,000	
銀行業 (0.7%)				
しずおかフィナンシャル	17	15	20,227	
コンソルディア・フィナンシャル	17	15	12,747	
あおぞら銀行	1.7	1.5	3,740	
三菱UFJフィナンシャルG	17	15	23,152	
りそなホールディングス	1.7	1.5	1,561	
三井住友トラストHD	1.7	3	10,833	
三井住友フィナンシャルG	1.7	1.5	15,060	
千葉銀行	17	15	18,540	
ふくおかフィナンシャルG	3.4	3	11,892	
みずほフィナンシャルG	1.7	1.5	4,635	
証券、商品先物取引業 (0.2%)				
大和証券G本社	17	15	16,440	
野村ホールディングス	17	15	12,553	
松井証券	17	—	—	
保険業 (1.2%)				
SOMPOホールディングス	3.4	9	29,790	
MS & AD	5.1	13.5	44,860	
第一生命HLDGS	1.7	1.5	6,190	
東京海上HD	25.5	22.5	123,817	
T&Dホールディングス	3.4	3	7,228	
その他金融業 (0.9%)				
クレディセゾン	17	15	48,180	
オリックス	17	15	51,630	
日本取引所グループ	17	15	50,850	
不動産業 (1.2%)				
東急不動産HD	17	15	15,247	
三井不動産	17	45	67,162	

銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株
三菱地所	17	15	35,985	
東京建物	8.5	7.5	18,202	
住友不動産	17	15	71,310	
サービス業 (4.4%)				
エムスリー	40.8	36	46,386	
ディー・エヌ・エー	5.1	4.5	7,645	
電通グループ	17	15	63,795	
オリエンタルランド	17	15	58,050	
サイバーエージェント	13.6	12	11,648	
楽天グループ	17	15	13,161	
リクルートホールディングス	51	45	383,580	
日本郵政	17	15	21,412	
セコム	17	15	144,705	
		千株	千株	千円
合計	株数、金額	3,704.3	4,077	17,155,459
	銘柄数<比率>	225銘柄	225銘柄	<93.7%>

(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	1,152	—

(注) 単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入の状況

項 目	当 期 末	
	貸 付	借 入
株式	株 (141,100 —)	株 (— —)

(注) ()内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。

ミリオン・インデックスマザーファンド

■投資信託財産の構成

2024年8月19日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	17,155,459 千円	87.7 %
コール・ローン等、その他	2,399,332	12.3
投資信託財産総額	19,554,791	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

2024年8月19日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	19,730,756,392円
コール・ローン等	2,267,011,779
株式 (評価額)	17,155,459,500
未取配当金	19,845,100
その他未収収益	43,513
差入委託証拠金	288,396,500
(B) 負債	1,413,530,479
未払金	140,969,050
未払解約金	9,400,000
未払利息	130,932
差入委託証拠金代用有価証券	175,964,500
受入担保金	1,087,065,997
(C) 純資産総額 (A - B)	18,317,225,913
元本	7,812,391,989
次期繰越損益金	10,504,833,924
(D) 受益権総口数	7,812,391,989口
1万口当り基準価額 (C / D)	23,446円

* 期首における元本額は8,669,355,346円、当作成期間中における追加設定元本額は11,690,438円、同解約元本額は868,653,795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：

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	7,654,470,142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	56,068,619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	101,853,228円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は23,446円です。

■損益の状況

当期 自 2023年8月18日 至 2024年8月19日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	326,980,870円
受取配当金	324,459,834
受取利息	1,057,397
その他収益金	1,757,396
支払利息	△ 293,757
(B) 有価証券売買損益	3,010,973,937
売買益	3,700,045,292
売買損	△ 689,071,355
(C) 先物取引等損益	37,468,250
取引益	206,267,700
取引損	△ 168,799,450
(D) 当期損益金 (A + B + C)	3,375,423,057
(E) 前期繰越損益金	8,224,247,510
(F) 解約差損益金	△ 1,113,146,205
(G) 追加信託差損益金	18,309,562
(H) 合計 (D + E + F + G)	10,504,833,924
次期繰越損益金 (H)	10,504,833,924

(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。

「日経平均トータルリターン・インデックス」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「日経平均トータルリターン・インデックス」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・インデックスマザーファンド」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。