

# 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34期

（決算日 2021年8月17日）

（作成対象期間 2020年8月18日～2021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。

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		
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
30期末(2017年8月17日)	6,253	5	17.9	19,702.63	17.7	99.3	0.6	19,622
31期末(2018年8月17日)	7,080	5	13.3	22,270.38	13.0	96.2	3.6	18,968
32期末(2019年8月19日)	6,564	5	△ 7.2	20,563.16	△ 7.7	98.6	1.4	16,307
33期末(2020年8月17日)	7,400	5	12.8	23,096.75	12.3	98.2	1.8	16,727
34期末(2021年8月17日)	8,779	5	18.7	27,424.47	18.7	96.0	3.9	16,379

(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。

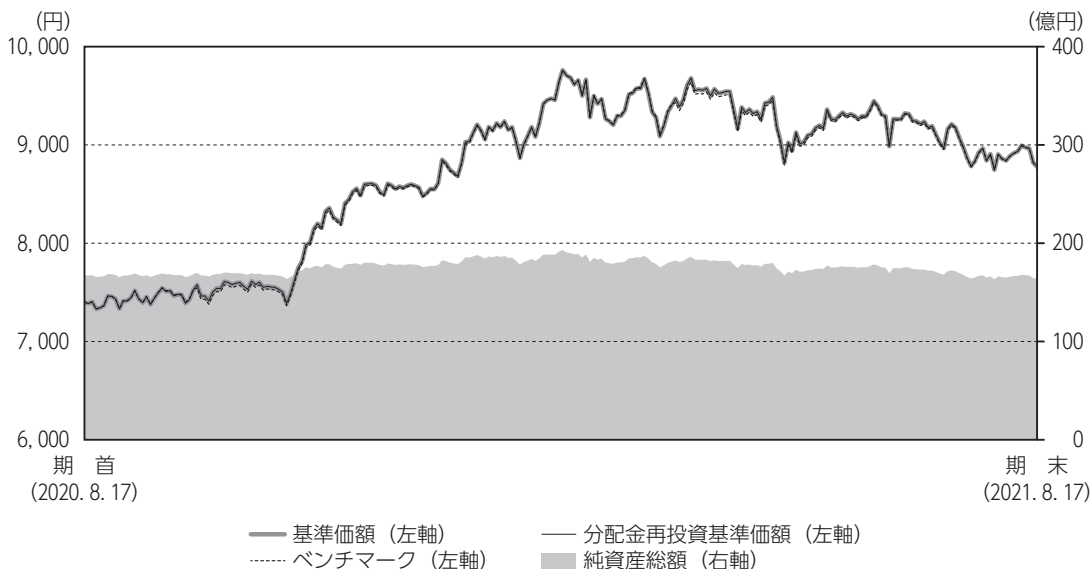
(注3) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



(注) 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。

\* 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株価です。

#### ■ 基準価額・騰落率

期首：7,400円

期末：8,779円（分配金5円）

騰落率：18.7%（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 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) 2020年 8月17日	7,400	—	23,096.75	—	98.2	1.8
8月末	7,413	0.2	23,139.76	0.2	98.4	1.5
9月末	7,463	0.9	23,185.12	0.4	98.7	1.2
10月末	7,386	△ 0.2	22,977.13	△ 0.5	95.6	4.3
11月末	8,487	14.7	26,433.62	14.4	97.1	2.8
12月末	8,810	19.1	27,444.17	18.8	98.8	1.0
2021年 1月末	8,868	19.8	27,663.39	19.8	97.4	2.4
2月末	9,282	25.4	28,966.01	25.4	96.1	3.8
3月末	9,389	26.9	29,178.80	26.3	96.9	3.0
4月末	9,261	25.1	28,812.63	24.7	98.3	1.6
5月末	9,268	25.2	28,860.08	25.0	98.8	1.1
6月末	9,241	24.9	28,791.53	24.7	95.1	4.7
7月末	8,747	18.2	27,283.59	18.1	95.7	4.1
(期末) 2021年 8月17日	8,784	18.7	27,424.47	18.7	96.0	3.9

(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

（2020. 8. 18 ~ 2021. 8. 17）

### 国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、国内外の新型コロナウイルスの感染状況などに一喜一憂を繰り返す相場となり、横ばい圏で推移しました。2020年11月以降は、米国大統領選挙において民主党のバイデン氏が当選確実となって選挙結果に対する不確実性が後退したことや、それによって大型経済対策への期待が高まったこと、欧米において複数のワクチンの接種が始まったことなどが好感され、株価は上昇しました。2021年に入っても、1月に行われた米国ジョージア州における上院決選投票で民主党候補が勝利し、大型経済対策などの政策の実現化が現実味を帯び、3月には実際に米国で追加経済対策が発表されたことや、国内のウイルスの感染状況が改善したことなどが好感され、株価は上昇しました。その後は、国内で感染が再拡大して再び行動制限措置がとられたことや、内閣支持率の低下で政局の行方に不透明感が増したこと、また世界的なインフレ懸念の高まりで米国の金融緩和縮小の早期化観測が高まったことなどから、上値の重い展開となりました。

## 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

(2020. 8. 18 ~ 2021. 8. 17)

### ■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。

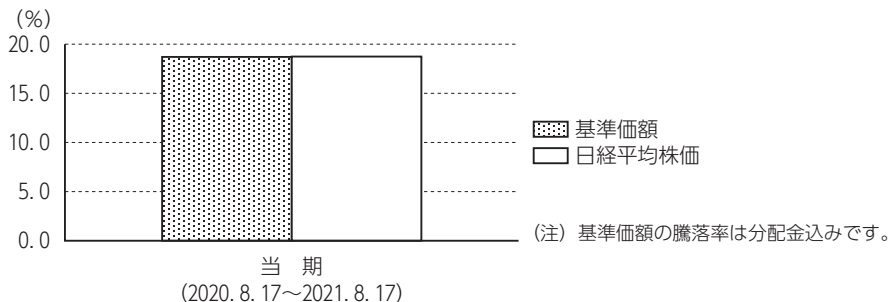
\* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

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	日経平均株価

## ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は18.7%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18.7%の上昇となりました。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ことや、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が、結果はほぼ同じとなりました。

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株価です。

## 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	
	2020年8月18日 ～2021年8月17日	
<b>当期分配金（税込み）</b>	<b>（円）</b>	<b>5</b>
対基準価額比率	（％）	0.06
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）	5,027

- (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	1,369.13
(c) 収益調整金	✓ 1,894.75
(d) 分配準備積立金	1,768.42
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	5,032.32
(f) 分配金	5.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	5,027.32

- (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 (2020. 8. 18~2021. 8. 17)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	146円	1.672%	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8,723円です。
(投 信 会 社)	(33)	(0.374)	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)	(106)	(1.210)	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)	(8)	(0.088)	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	0	0.006	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)	(0)	(0.006)	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
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	146	1.678	

(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。

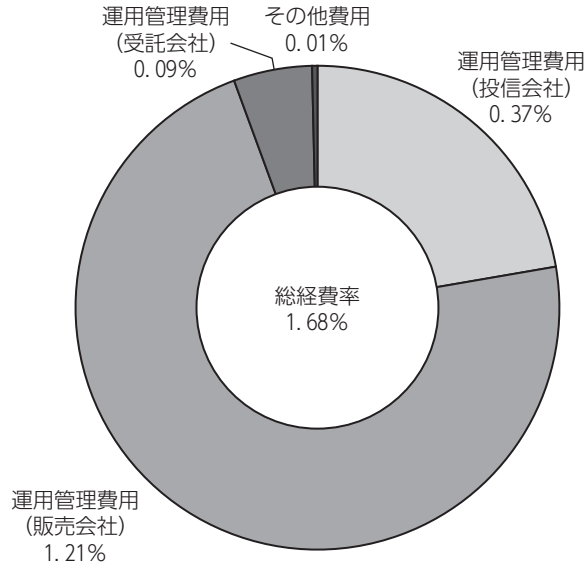
(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。



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1.68%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

(2020年8月18日から2021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	—	—	2,359,349	3,749,600

(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

(2020年8月18日から2021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	4,258,311千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	17,207,451千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.24	

(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

(2020年8月18日から2021年8月17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	211	—	—	4,047	840	20.8
株式先物取引	5,048	—	—	4,757	—	—
コール・ローン	401,829	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合98.2%

※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

(2020年8月18日から2021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	当作成期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	—	2	12

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

### (4) 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

(2020年8月18日から2021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	
	百万円	
株式	30	

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

### (5) 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、当作成期中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	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円	千口	千口	千円
ミリオン・インデックスマザーファンド	12,468,495	10,109,146	16,378,839			

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2021年8月17日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ミリオン・インデックスマザーファンド	16,378,839 千円	99.0 %
コール・ローン等、その他	157,590	1.0
投資信託財産総額	16,536,430	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

2021年8月17日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>16,536,430,451円</b>
コール・ローン等	156,190,931
ミリオン・インデックス マザーファンド（評価額）	16,378,839,520
未収入金	1,400,000
<b>(B) 負債</b>	<b>157,094,188</b>
未払収益分配金	9,328,509
未払解約金	1,371,483
未払信託報酬	145,914,305
その他未払費用	479,891
<b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>	<b>16,379,336,263</b>
元本	18,657,019,888
次期繰越損益金	△ 2,277,683,625
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>18,657,019,888口</b>
1万口当り基準価額 (C / D)	8,779円

\* 期首における元本額は22,604,281,039円、当作成期間中における追加設定元本額は246,862,807円、同解約元本額は4,194,123,958円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は8,779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2,277,683,625円です。

## ■損益の状況

当期 自 2020年8月18日 至 2021年8月17日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>△ 20,667円</b>
受取利息	1,424
支払利息	△ 22,091
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>2,848,770,331</b>
売買益	3,370,203,948
売買損	△ 521,433,617
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 294,353,018</b>
<b>(D) 当期損益金 (A + B + C)</b>	<b>2,554,396,646</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>3,299,341,590</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>△ 8,122,093,352</b>
(配当等相当額)	( 3,535,054,208)
(売買損益相当額)	(△ 11,657,147,560)
<b>(G) 合計 (D + E + F)</b>	<b>△ 2,268,355,116</b>
<b>(H) 収益分配金</b>	<b>△ 9,328,509</b>
次期繰越損益金 (G + H)	△ 2,277,683,625
追加信託差損益金	△ 8,131,421,861
(配当等相当額)	( 3,525,725,699)
(売買損益相当額)	(△ 11,657,147,560)
分配準備積立金	5,853,758,903
繰越損益金	△ 20,667

(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	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	2,554,396,646
(c) 収益調整金	3,535,054,208
(d) 分配準備積立金	3,299,363,127
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	9,388,813,111
(f) 分配金	9,328,509
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	9,379,484,602
(h) 受益権総口数	18,657,019,888口

## 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

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。

### 【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34期 (決算日 2021年8月17日)

(作成対象期間 2020年8月18日～2021年8月17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、日経平均株価をモデルとして運用を行いません。
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

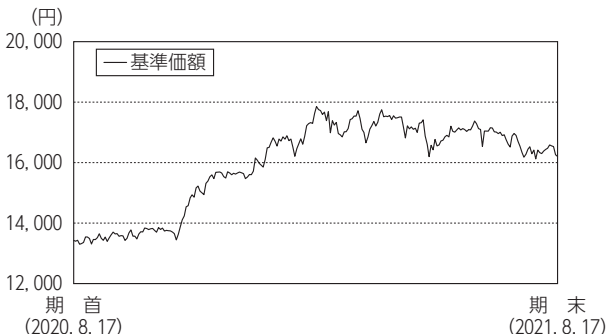
## 大和アセットマネジメント

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		日経平均株価 (ベンチマーク)		株式 組入 比率	株式 先物 比率
	円	%	円	%		
(期首)2020年8月17日	13,425	—	23,096.75	—	98.1	1.8
8月末	13,457	0.2	23,139.76	0.2	98.4	1.5
9月末	13,566	1.1	23,185.12	0.4	98.7	1.2
10月末	13,445	0.1	22,977.13	△ 0.5	95.6	4.3
11月末	15,470	15.2	26,433.62	14.4	97.1	2.8
12月末	16,081	19.8	27,444.17	18.8	98.9	1.0
2021年1月末	16,208	20.7	27,663.39	19.8	97.2	2.4
2月末	16,987	26.5	28,966.01	25.4	96.1	3.8
3月末	17,209	28.2	29,178.80	26.3	97.0	3.0
4月末	16,997	26.6	28,812.63	24.7	98.3	1.6
5月末	17,033	26.9	28,860.08	25.0	98.9	1.1
6月末	17,008	26.7	28,791.53	24.7	95.1	4.7
7月末	16,121	20.1	27,283.59	18.1	95.8	4.1
(期末)2021年8月17日	16,202	20.7	27,424.47	18.7	96.0	3.9

(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：13,425円 期末：16,202円 騰落率：20.7%

【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

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、国内外の新型コロナウイルスの感染状況などに一喜一憂を繰り返す相場となり、横ばい圏で推移しました。2020年11月以降は、米国大統領選挙において民主党のバイデン氏が当選確定となって選挙結果に対する不確実性が後退したことや、それによって大型経済対策への期待が高まったこと、欧米において複数のワクチンの接種が始まったことなどが好感され、株価は上昇しました。2021年に入っても、1月に行われた米国ジョージア州における上院決選投票で民主党候補が勝利し、大型経済対策などの政策の実現化が現実味を帯び、3月には実際に米国で追加経済対策が発表されたことや、国内のウイルスの感染状況が改善したことなどが好感され、株価は上昇しました。その後は、国内で感染が再拡大して再び行動制限措置がとられたことや、内閣支持率の低下で政局の行方に不透明感が増したこと、また世界的なインフレ懸念の高まりで米国の金融緩和縮小の早期化観測が高まったことから、上値の重い展開となりました。

◆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

ベンチマークの騰落率は18.7%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20.7%の上昇となりました。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、ベンチマークとかい離しました。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。

※ベンチマークは日経平均株価です。

《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 (その他)	0 ( 0)
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

(2020年8月18日から2021年8月17日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 100 ( 18.4)	千円 211,087 ( 一)	千株 1,036.5	千円 4,047,224

(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

(2020年8月18日から2021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	百万円 5,048	百万円 4,757	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

(2020年8月18日から2021年8月17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
ネクソン	千株 50	千円 146,944	円 2,938	ファーストリテイリング	千株 5	千円 429,151	円 85,830
シャープ	24	33,528	1,397	ソフトバンクグループ	30	242,533	8,084
ソフトバンク	26	30,615	1,177	ファミリーマート	104	237,670	2,285
				東京エレクトロン	5	190,192	38,038
				ファナック	5	125,614	25,122
				ダイキン工業	5	109,655	21,931
				エムスリー	12	99,165	8,263
				KDDI	30	96,191	3,206
				テルモ	20	86,520	4,326
				信越化学	5	86,326	17,265

(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
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>					日本化薬	26	—	—		東洋製糖グループHD	26	21	32,004	
日本水産	26	21	12,180		花王	26	21	139,272		機械 (5.4%)				
マルハニチロ	2.6	2.1	4,941		D I C	2.6	2.1	6,262		日本製鋼所	5.2	4.2	10,735	
<b>鉱業 (0.0%)</b>					富士フィルム HLDGS	26	21	181,419		オークマ	5.2	4.2	21,378	
I N P E X	10.4	8.4	6,459		資生堂	26	21	150,360		アマダ	26	21	22,848	
<b>建設業 (1.7%)</b>					日東電工	26	21	171,360		小松製作所	26	21	57,550	
コムシスホールディングス	26	21	61,446		<b>医薬品 (7.6%)</b>					住友重機械	5.2	4.2	12,528	
大成建設	5.2	4.2	15,015		協和キリン	26	21	72,450		日立建機	26	21	64,050	
大林組	26	21	19,110		武田薬品	26	21	76,671		クボタ	26	21	47,124	
清水建設	26	21	17,094		アステラス製薬	130	105	185,115		荏原製作所	5.2	4.2	24,108	
長谷工コーポレーション	5.2	4.2	6,253		大日本住友製薬	26	21	40,593		ダイキン工業	26	21	542,745	
鹿島建設	13	10.5	14,847		塩野義製薬	26	21	137,109		日本精工	26	21	17,241	
大和ハウス	26	21	69,321		中外製薬	78	63	256,347		N T N	26	21	5,397	
積水ハウス	26	21	45,223		エーザイ	26	21	189,231		ジェイテクト	26	21	21,273	
日揮ホールディングス	26	21	19,509		第一三共	26	63	152,271		日立造船	5.2	4.2	3,511	
<b>食料品 (3.6%)</b>					大塚ホールディングス	26	21	98,028		三菱重工業	2.6	2.1	6,105	
日清製粉G本社	26	21	37,191		<b>石油・石炭製品 (0.2%)</b>					I H I	2.6	2.1	5,331	
明治ホールディングス	5.2	4.2	27,762		出光興産	10.4	8.4	21,722		<b>電気機器 (22.6%)</b>				
日本ハム	13	10.5	44,152		ENEOSホールディングス	26	21	9,177		日清紡ホールディングス	26	21	19,299	
サッポロホールディングス	5.2	4.2	9,794		<b>ゴム製品 (0.8%)</b>					コニカミノルタ	26	21	11,676	
アサヒグループホールディングス	26	21	107,667		横浜ゴム	13	10.5	21,115		ミネベアミツミ	26	21	59,619	
キリンHD	26	21	40,530		ブリヂストン	26	21	106,407		日立	5.2	4.2	26,178	
宝ホールディングス	26	21	28,518		<b>ガラス・土石製品 (1.1%)</b>					三菱電機	26	21	31,048	
キッコーマン	26	21	148,890		A G C	5.2	4.2	20,811		富士電機	5.2	4.2	19,341	
味の素	26	21	63,651		日本板硝子	2.6	2.1	1,197		安川電機	26	21	113,400	
ニチレイ	13	10.5	27,205		日本電気硝子	7.8	6.3	15,252		オムロン	26	21	203,700	
日本たばこ産業	26	21	44,856		住友大阪セメント	2.6	2.1	6,394		ジーエス・ユアサ コーポ	5.2	4.2	10,668	
<b>繊維製品 (0.2%)</b>					太平洋セメント	2.6	2.1	5,397		日本電気	2.6	2.1	11,550	
東洋紡	2.6	2.1	2,883		東海カーボン	26	21	32,214		富士通	2.6	2.1	39,700	
ユニチカ	2.6	2.1	709		T O T O	13	10.5	61,320		沖電気	2.6	2.1	2,037	
帝人	5.2	4.2	6,724		日本碍子	26	21	37,632		セイコーエプソン	52	42	88,368	
東レ	26	21	15,340		<b>鉄鋼 (0.1%)</b>					パナソニック	26	21	27,688	
<b>パルプ・紙 (0.1%)</b>					日本製鉄	2.6	2.1	4,465		シャープ	—	21	31,311	
王子ホールディングス	26	21	12,621		神戸製鋼所	2.6	2.1	1,495		ソーニーグループ	26	21	225,120	
日本製紙	2.6	2.1	2,658		J F Eホールディングス	2.6	2.1	3,387		T D K	26	21	244,650	
<b>化学 (8.0%)</b>					大平洋金属	2.6	2.1	3,446		アルプスアルパイン	26	21	22,491	
クラレ	26	21	21,609		<b>非鉄金属 (0.8%)</b>					横河電機	26	21	35,616	
旭化成	26	21	24,412		日本軽金属HD	26	2.1	4,055		アドバンテスト	52	42	380,940	
昭和電工	2.6	2.1	6,667		三井金属	2.6	2.1	7,276		カシオ	26	21	36,750	
住友化学	26	21	11,718		東邦亜鉛	2.6	2.1	4,183		ファナック	26	21	497,805	
日産化学	26	21	116,130		三菱マテリアル	2.6	2.1	4,867		京セラ	52	42	278,082	
東ソー	13	10.5	20,244		住友鉱山	13	10.5	44,236		太陽誘電	26	21	122,220	
トクヤマ	5.2	4.2	9,576		DOWAホールディングス	5.2	4.2	19,719		SCREENホールディングス	5.2	4.2	39,606	
デンカ	5.2	4.2	15,771		古河電工	2.6	2.1	5,115		キャノン	39	31.5	81,726	
信越化学	26	21	370,650		住友電工	26	21	31,363		リコー	26	21	22,869	
三井化学	5.2	4.2	16,002		フジクラ	26	21	12,348		東京エレクトロン	26	21	936,600	
三菱ケミカル HLDGS	13	10.5	9,857		<b>金属製品 (0.2%)</b>					<b>輸送用機器 (4.8%)</b>				
宇部興産	2.6	2.1	4,643		S U M C O	2.6	2.1	4,697		デンソー	26	21	162,162	



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	株数	評価額	千円
三井E&SHD	2.6	2.1	1,125	
川崎重工業	2.6	2.1	4,918	
日産自動車	26	21	12,169	
いすゞ自動車	13	10.5	15,435	
トヨタ自動車	26	21	204,813	
日野自動車	26	21	19,089	
三菱自動車工業	2.6	2.1	611	
マツダ	5.2	4.2	4,069	
本田技研	52	42	146,706	
スズキ	26	21	97,818	
SUBARU	26	21	44,614	
ヤマハ発動機	26	21	58,233	
<b>精密機器 (3.7%)</b>				
テルモ	104	84	366,408	
ニコン	26	21	24,423	
オリンパス	104	84	185,262	
シチズン時計	26	21	10,311	
<b>その他製品 (2.0%)</b>				
パンダイナムコHLDGS	26	21	151,683	
凸版印刷	13	10.5	19,624	
大日本印刷	13	10.5	26,533	
ヤマハ	26	21	129,570	
<b>電気・ガス業 (0.1%)</b>				
東京電力HD	2.6	2.1	602	
中部電力	2.6	2.1	2,796	
関西電力	2.6	2.1	2,291	
東京瓦斯	5.2	4.2	8,956	
大阪瓦斯	5.2	4.2	8,698	
<b>陸運業 (1.6%)</b>				
東武鉄道	5.2	4.2	11,734	
東急	13	10.5	15,414	
小田急電鉄	13	10.5	26,544	
京王電鉄	5.2	4.2	24,906	
京成電鉄	13	10.5	33,705	
東日本旅客鉄道	2.6	2.1	15,145	
西日本旅客鉄道	2.6	2.1	12,184	
東海旅客鉄道	2.6	2.1	33,316	
日本通運	2.6	2.1	15,141	
ヤマトホールディングス	26	21	60,018	
<b>海運業 (0.3%)</b>				
日本郵船	2.6	2.1	17,577	
商船三井	2.6	2.1	15,645	
川崎汽船	2.6	2.1	10,836	
<b>空運業 (0.0%)</b>				
ANAホールディングス	2.6	2.1	5,297	
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>				
三菱倉庫	13	10.5	32,445	
<b>情報・通信業 (11.5%)</b>				
ネクソン	—	42	90,216	
Zホールディングス	10.4	8.4	5,290	

銘柄	期首		当期末	
	株数	株数	評価額	千円
トレンドマイクロ	26	21	120,750	
スカパー JSATHD	2.6	2.1	840	
日本電信電話	10.4	8.4	24,011	
KDDI	156	126	420,840	
ソフトバンク	—	21	30,765	
NTTドコモ	2.6	—	—	
東宝	2.6	2.1	9,628	
NTTデータ	130	105	188,580	
コナミホールディングス	26	21	138,810	
ソフトバンクグループ	156	126	808,668	
<b>卸売業 (2.2%)</b>				
双日	2.6	2.1	678	
伊藤忠	26	21	70,875	
丸紅	26	21	18,988	
豊田通商	26	21	110,880	
三井物産	26	21	53,560	
住友商事	26	21	32,802	
三菱商事	26	21	69,006	
<b>小売業 (11.1%)</b>				
J.フロントリテイリング	13	10.5	9,922	
三越伊勢丹HD	26	21	15,225	
セブン&アイ・HLDGS	26	21	101,010	
ファミリーマート	104	—	—	
高島屋	13	10.5	11,560	
丸井グループ	26	21	39,690	
イオン	26	21	63,105	
ファーストリテイリング	26	21	1,536,150	
<b>銀行業 (0.6%)</b>				
コンソルディア・フィナンシャル	26	21	9,114	
新生銀行	2.6	2.1	2,979	
あおぞら銀行	2.6	2.1	5,434	
三菱UFJフィナンシャルG	26	21	12,574	
りそなホールディングス	2.6	2.1	895	
三井住友トラストHD	2.6	2.1	7,660	
三井住友フィナンシャルG	2.6	2.1	7,952	
千葉銀行	26	21	14,238	
ふくおかフィナンシャルG	5.2	4.2	8,471	
静岡銀行	26	21	18,081	
みずほフィナンシャルG	26	2.1	3,353	
<b>証券・商品先物取引業 (0.3%)</b>				
大和証券G本社	26	21	12,579	
野村ホールディングス	26	21	11,340	
松井証券	26	21	16,653	
<b>保険業 (0.7%)</b>				
SOMPOホールディングス	6.6	5.3	24,963	
M&A D	7.8	6.3	21,949	
第一生命HLDGS	2.6	2.1	4,622	
東京海上HD	13	10.5	55,755	
T&Dホールディングス	5.2	4.2	5,947	

銘柄	期首		当期末	
	株数	株数	評価額	千円
<b>その他金融業 (0.5%)</b>				
クレディセゾン	26	21	26,145	
日本取引所グループ	26	21	53,109	
<b>不動産業 (1.2%)</b>				
東急不動産HD	26	21	12,516	
三井不動産	26	21	51,355	
三菱地所	26	21	35,815	
東京建物	13	10.5	17,167	
住友不動産	26	21	72,702	
<b>サービス業 (6.7%)</b>				
エムスリー	62.4	50.4	341,359	
ディー・エヌ・エー	7.8	6.3	12,379	
電通グループ	26	21	85,365	
サイバーエージェント	5.2	16.8	32,088	
楽天グループ	26	21	25,095	
リクルートホールディングス	78	63	378,000	
日本郵政	26	21	19,706	
セコム	26	21	175,119	
合計	株数、金額	4,741.2	3,823.1	15,992,785
	銘柄数<比率>	225銘柄	225銘柄	<96.0%>

(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	656	—

(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 173,800 (—)	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

2021年8月17日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	15,992,785	92.5
コール・ローン等、その他	1,290,540	7.5
投資信託財産総額	17,283,326	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

2021年8月17日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>17,371,810,342円</b>
コール・ローン等	1,239,777,988
株式(評価額)	15,992,785,500
未収配当金	16,653,400
未収利息	28,405
その他未収収益	1,541,049
差入委託証拠金	121,024,000
<b>(B) 負債</b>	<b>708,950,460</b>
未払金	35,433,200
未払解約金	1,400,000
差入委託証拠金代用有価証券	88,484,000
受入担保金	583,633,260
<b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>	<b>16,662,859,882</b>
元本	10,284,692,590
次期繰越損益金	6,378,167,292
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>10,284,692,590口</b>
1万口当り基準価額 (C / D)	16,202円

\* 期首における元本額は12,704,676,821円、当作成期間中における追加設定元本額は1,234,873円、同解約元本額は2,421,219,104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10,109,146,723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88,588,510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86,957,357円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は16,202円です。

## ■損益の状況

当期 自 2020年8月18日 至 2021年8月17日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>288,190,855円</b>
受取配当金	280,511,988
受取利息	1,322,608
その他収益金	6,852,613
支払利息	△ 496,354
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>3,098,776,079</b>
売買益	3,468,768,205
売買損	△ 369,992,126
<b>(C) 先物取引等損益</b>	<b>65,689,450</b>
取引益	137,586,150
取引損	△ 71,896,700
<b>(D) その他費用</b>	<b>△ 12,182</b>
<b>(E) 当期損益金 (A + B + C + D)</b>	<b>3,452,644,202</b>
<b>(F) 前期繰越損益金</b>	<b>4,351,338,859</b>
<b>(G) 解約差損益金</b>	<b>△ 1,426,580,896</b>
<b>(H) 追加信託差損益金</b>	<b>765,127</b>
<b>(I) 合計 (E + F + G + H)</b>	<b>6,378,167,292</b>
次期繰越損益金 (I)	6,378,167,292

(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。