

運用報告書 (全体版)

第33期<決算日2020年10月29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	「ミリオン・インデックスマザーファンド」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	ミリオン・インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	ミリオン・インデックスマザーファンド	日経平均株価（日経225）に採用された銘柄を投資対象とします。
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銘柄に原則として等株数投資を行い、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	ミリオン・インデックス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。
	ミリオン・インデックスマザーファンド	株式への投資割合には、制限を設けません。
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、2020年10月29日に第33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オン

■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
29期(2016年10月31日)	5,857	0	△7.7	17,425.02	△8.0	91.1	8.3	3,611
30期(2017年10月30日)	7,345	60	26.4	22,011.67	26.3	93.0	6.4	4,068
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

(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	%	%	%
2019年10月29日	7,660	—	22,974.13	—	90.3	9.2
10月末	7,644	△0.2	22,927.04	△0.2	90.3	9.2
11月末	7,756	1.3	23,293.91	1.4	91.0	8.7
12月末	7,877	2.8	23,656.62	3.0	91.8	7.7
2020年1月末	7,718	0.8	23,205.18	1.0	92.2	7.2
2月末	7,028	△8.3	21,142.96	△8.0	92.4	7.2
3月末	6,344	△17.2	18,917.01	△17.7	91.4	8.2
4月末	6,755	△11.8	20,193.69	△12.1	91.7	7.7
5月末	7,307	△4.6	21,877.89	△4.8	92.4	7.2
6月末	7,447	△2.8	22,288.14	△3.0	93.0	6.7
7月末	7,245	△5.4	21,710.00	△5.5	93.6	6.2
8月末	7,707	0.6	23,139.76	0.7	94.7	5.1
9月末	7,757	1.3	23,185.12	0.9	94.8	4.5
(期末)						
2020年10月29日	7,796	1.8	23,331.94	1.6	96.4	3.5

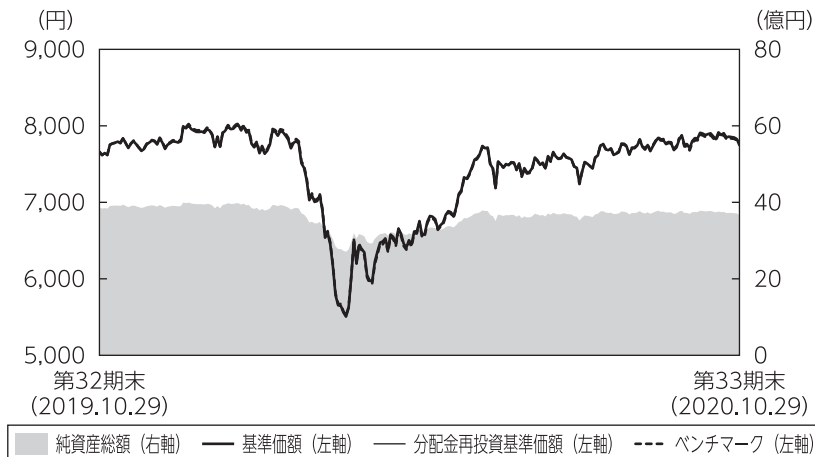
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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 (2019年10月30日から2020年10月29日まで)

基準価額等の推移



第33期首： 7,660円
第33期末： 7,746円
(既払分配金50円)
騰落率： 1.8%
(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

ミリオン・インデックス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、市況が上昇したことなどから、基準価額は上昇しました。

投資環境

●国内株式市況

国内株式市場は、2019年の年末にかけて、米中貿易協議への進展期待等から、概ね上昇基調で推移しました。しかし、2020年2月半ばから3月半ばにかけて、新型コロナウイルス感染拡大や原油価格の急落などを受け、国内外の金融市場が大きな混乱に見舞われたことから、大幅下落となりました。その後は、国内における感染拡大鈍化や各国政府の金融政策等が好感され、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

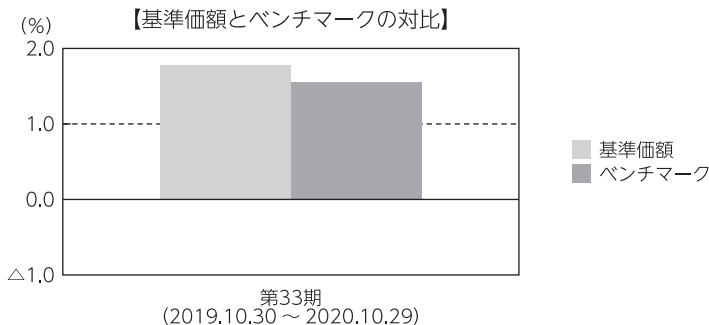
当期の運用につきましては、当ファンドの運用方針に従い、ミリオン・インデックスマザーファンド受益証券の組入比率を高位に維持しました。

●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銘柄に等株数投資を行いました。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1.6%上昇しました。当ファンドはベンチマークを0.2%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
	2019年10月30日 ～2020年10月29日
当期分配金（税引前）	50円
対基準価額比率	0.64%
当期の収益	50円
当期の収益以外	-円
翌期繰越分配対象額	4,670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、ミリオン・インデックス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。

●ミリオン・インデックスマザーファンド

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銘柄に等株数投資を行い、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33期		項目の概要
	(2019年10月30日 ～2020年10月29日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	126円	1.705%	(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7,418円です。
(投信会社)	(30)	(0.407)	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)	(90)	(1.210)	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)	(7)	(0.088)	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	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
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	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
(c) その他費用	0	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)	(0)	(0.001)	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	127	1.707	

(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。

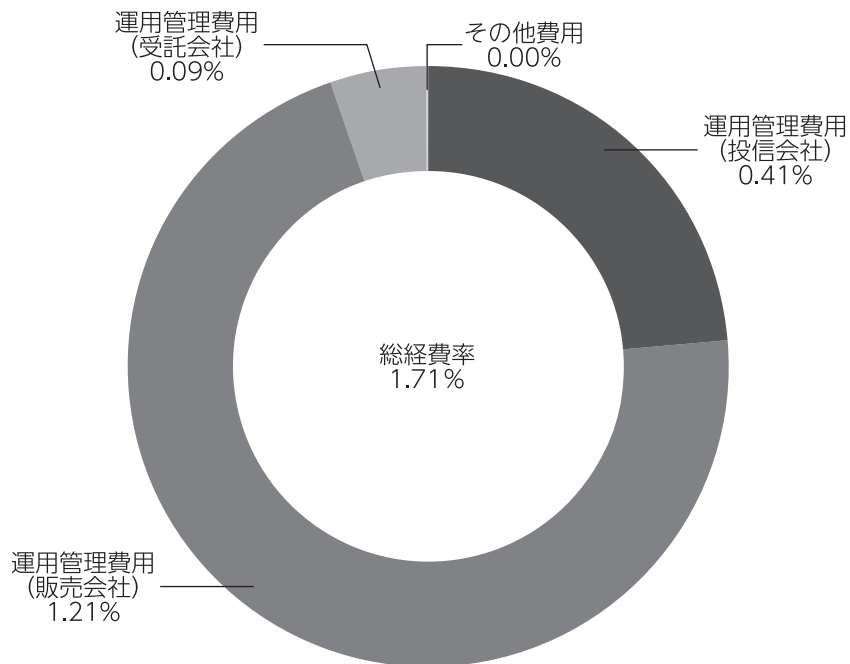
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.71%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（2019年10月30日から2020年10月29日まで）

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ミリオン・インデックスマザーファンド	千口 26,855	千円 37,814	千口 237,366	千円 355,354

■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	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	122,296千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	3,689,150千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.03

(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（2019年10月30日から2020年10月29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
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)	36千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	0.601千円
(B) / (A)	1.6%

(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。

【ミリオン・インデックス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

決 算 期	当 期					
	区 分	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
株 式						
株 式 先 物 取 引	1,213	-	-	1,479	46	3.2

平均保有割合 90.9%

(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 -	百万円 -	百万円 0.7689

(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 7

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
ミリオン・インデックスマザーファンド	千円 2,569,360	千円 2,358,849	千円 3,665,652

■投資信託財産の構成

2020年10月29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	千円 3,665,652	% 98.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	59,116	1.6
投 資 信 託 財 産 総 額	3,724,768	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

(2020年10月29日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	3,724,768,981円
コール・ローン等	31,475,167
ミリオン・インデックス マザーファンド(評価額)	3,665,652,814
未 収 入 金	27,641,000
(B) 負 債	57,211,530
未 払 収 益 分 配 金	23,672,566
未 払 解 約 金	2,529,369
未 払 信 託 報 酬	30,980,970
そ の 他 未 払 費 用	28,625
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	3,667,557,451
元 本	4,734,513,347
次 期 繰 越 損 益 金	△1,066,955,896
(D) 受 益 権 総 口 数	4,734,513,347口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	7,746円

(注) 期首における元本額は5,036,949,214円、当期中における追加設定元本額は114,157,641円、同解約元本額は416,593,508円です。

■損益の状況

当期 自2019年10月30日 至2020年10月29日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△7,190円
受 取 利 息	301
支 払 利 息	△7,491
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	130,493,486
売 買 益	142,960,762
売 買 損	△12,467,276
(C) 信 託 報 酬 等	△62,066,976
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	68,419,320
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,204,746,629
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△2,316,449,279
(配 当 等 相 当 額)	(961,487,552)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△3,277,936,831)
(G) 合 計(D+E+F)	△1,043,283,330
(H) 収 益 分 配 金	△23,672,566
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	△1,066,955,896
追 加 信 託 差 損 益 金	△2,316,449,279
(配 当 等 相 当 額)	(961,658,759)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△3,278,108,038)
分 配 準 備 積 立 金	1,249,493,383

(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	31,883,365円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	36,535,955
(c) 収 益 調 整 金	961,658,759
(d) 分 配 準 備 積 立 金	1,204,746,629
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	2,234,824,708
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	4,720.28
(g) 分 配 金	23,672,566
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	50

■分配金のお知らせ

1万口当たり分配金

50円

※分配金を再投資する場合、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。

ミリオン・インデックスマザーファンド

運用報告書

第33期（決算日 2020年10月29日）

（計算期間 2019年10月30日～2020年10月29日）

ミリオン・インデックスマザーファンドの第33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	1987年10月30日から無期限です。
運用方針	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。 日経平均株価に採用されている銘柄の中から200～225銘柄に原則として等株数投資を行い、株式の組入比率を高位に保ちます。
主要投資対象	日経平均株価（日経225）に採用された銘柄を投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。

■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
	円	期中騰落率	(ベンチマーク) 円	期中騰落率			
29期（2016年10月31日）	1,074	△6.1	17,425.02	△8.0	91.2	8.3	3,983
30期（2017年10月30日）	1,381	28.6	22,011.67	26.3	93.1	6.4	4,458
31期（2018年10月29日）	1,352	△2.1	21,149.80	△3.9	86.1	13.3	3,978
32期（2019年10月29日）	1,501	11.0	22,974.13	8.6	90.3	9.2	4,236
33期（2020年10月29日）	1,554	3.5	23,331.94	1.6	96.4	3.5	4,027

（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）。

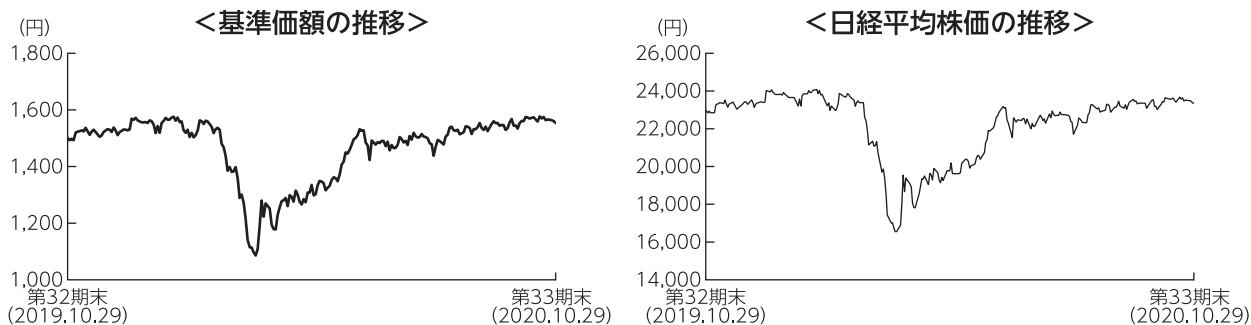
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		日 経 平 均 株 価 (ベンチマーク)		株 式 組入比率	株 式 先物比率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2019年10月29日	円 1,501	% -	円 22,974.13	% -	% 90.3	% 9.2
10月末	1,498	△0.2	22,927.04	△0.2	90.4	9.2
11月末	1,522	1.4	23,293.91	1.4	91.0	8.7
12月末	1,548	3.1	23,656.62	3.0	91.8	7.7
2020年 1 月末	1,519	1.2	23,205.18	1.0	92.3	7.2
2 月末	1,385	△7.7	21,142.96	△8.0	92.4	7.2
3 月末	1,252	△16.6	18,917.01	△17.7	91.4	8.2
4 月末	1,335	△11.1	20,193.69	△12.1	91.8	7.7
5 月末	1,446	△3.7	21,877.89	△4.8	92.4	7.2
6 月末	1,476	△1.7	22,288.14	△3.0	93.0	6.7
7 月末	1,438	△4.2	21,710.00	△5.5	93.7	6.2
8 月末	1,532	2.1	23,139.76	0.7	94.7	5.1
9 月末	1,544	2.9	23,185.12	0.9	94.8	4.5
(期 末) 2020年10月29日	1,554	3.5	23,331.94	1.6	96.4	3.5

(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（2019年10月30日から2020年10月29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3.5%上昇しました。

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、市況が上昇したことなどから、基準価額は上昇しました。

投資環境

●国内株式市況

国内株式市場は、2019年の年末にかけて、米中貿易協議への進展期待等から、概ね上昇基調で推移しました。しかし、2020年2月半ばから3月半ばにかけて、新型コロナウイルス感染拡大や原油価格の急落などを受け、国内外の金融市場が大きな混乱に見舞われたことから、大幅下落となりました。その後は、国内における感染拡大鈍化や各国政府の金融政策等が好感され、戻りを試す展開となりました。

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銘柄に等株数投資を行いました。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1.6%上昇しました。当ファンドはベンチマークを1.9%程度上回りました。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銘柄に等株数投資を行い、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。

■ 1千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 (先物・オプション)	0円 (0)	0.001% (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
合計	0	0.001	
期中の平均基準価額は1,467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「1千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 (2019年10月30日から2020年10月29日まで)

(1) 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	内 上 場	千株 24 (14.4)	千円 58,826 (-)	千株 31.2	千円 63,469

(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 1,213	百万円 1,479	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	122,296千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,689,150千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	0.03

(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（2019年10月30日から2020年10月29日まで）

(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	$\frac{B}{A}$	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 58	百万円 7	% 12.0	百万円 63	百万円 57	% 91.2
株式先物取引	1,213	-	-	1,479	46	3.2

(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 -	百万円 -	百万円 0.7689

(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 7

(4) 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)	40千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	0.66千円
(B) / (A)	1.6%

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です。

■組入資産の明細

(1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	千円
水産・農林業 (0.1%)				
日本水産	6	6	2,478	
マルハニチロ	0.6	0.6	1,323	
鉱業 (0.0%)				
国際石油開発帝石	2.4	2.4	1,211	
建設業 (1.7%)				
コムシスホールディングス	6	6	15,984	
大成建設	1.2	1.2	3,918	
大林組	6	6	5,238	
清水建設	6	6	4,362	
長谷工コーポレーション	1.2	1.2	1,537	
鹿島建設	3	3	3,363	
大和ハウス工業	6	6	16,959	
積水ハウス	6	6	10,548	
日揮ホールディングス	6	6	5,328	
食料品 (3.5%)				
日清製粉グループ本社	6	6	9,666	
明治ホールディングス	1.2	1.2	9,036	
日本ハム	3	3	12,960	
サッポロホールディングス	1.2	1.2	2,098	
アサヒグループホールディングス	6	6	20,100	
キリンホールディングス	6	6	11,601	
宝ホールディングス	6	6	6,480	
キッコーマン	6	6	31,680	
味の素	6	6	12,696	
ニチレイ	3	3	7,896	
日本たばこ産業	6	6	11,880	
繊維製品 (0.2%)				
東洋紡	0.6	0.6	858	
ユニチカ	0.6	0.6	214	
帝人	1.2	1.2	1,953	
東レ	6	6	2,914	
パルプ・紙 (0.1%)				
王子ホールディングス	6	6	2,730	
日本製紙	0.6	0.6	733	
化学 (8.1%)				
クラレ	6	6	5,916	
旭化成	6	6	5,575	
昭和電工	0.6	0.6	1,095	
住友化学	6	6	2,094	
日産化学	6	6	33,540	
東ソー	3	3	5,058	
トクヤマ	1.2	1.2	2,881	
デンカ	1.2	1.2	3,894	
信越化学工業	6	6	85,830	
三井化学	1.2	1.2	3,261	
三菱ケミカルホールディングス	3	3	1,778	
宇部興産	0.6	0.6	1,090	
日本化薬	6	-	-	
花王	6	6	45,516	
DIC	0.6	0.6	1,560	
富士フイルムホールディングス	6	6	32,190	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	千円
資生堂	6	6	39,270	
日東電工	6	6	45,180	
医薬品 (8.1%)				
協和キリン	6	6	15,906	
武田薬品工業	6	6	20,646	
アステラス製薬	30	30	43,845	
大日本住友製薬	6	6	7,608	
塩野義製薬	6	6	29,310	
中外製薬	6	18	74,250	
エーザイ	6	6	50,190	
第一三共	6	18	49,005	
大塚ホールディングス	6	6	23,892	
石油・石炭製品 (0.2%)				
出光興産	2.4	2.4	5,068	
E N E O Sホールディングス	6	6	2,129	
ゴム製品 (0.7%)				
横浜ゴム	3	3	4,572	
ブリヂストン	6	6	20,676	
ガラス・土石製品 (1.1%)				
A G C	1.2	1.2	3,852	
日本板硝子	0.6	0.6	220	
日本電気硝子	1.8	1.8	3,781	
住友大阪セメント	0.6	0.6	1,926	
太平洋セメント	0.6	0.6	1,494	
東海カーボン	6	6	7,356	
T O T O	3	3	14,220	
日本碍子	6	6	9,012	
鉄鋼 (0.1%)				
日本製鉄	0.6	0.6	621	
神戸製鋼所	0.6	0.6	249	
ジェイ エフ イー ホールディングス	0.6	0.6	444	
大平洋金属	0.6	0.6	983	
非鉄金属 (0.7%)				
日本軽金属ホールディングス	6	0.6	996	
三井金属鉱業	0.6	0.6	1,613	
東邦亜鉛	0.6	0.6	1,243	
三菱マテリアル	0.6	0.6	1,162	
住友金属鉱山	3	3	9,954	
D O W Aホールディングス	1.2	1.2	3,624	
古河電気工業	0.6	0.6	1,585	
住友電気工業	6	6	6,993	
フジクラ	6	6	1,698	
金属製品 (0.2%)				
S U M C O	0.6	0.6	979	
東洋製罐グループホールディングス	6	6	5,928	
機械 (5.0%)				
日本製鋼所	1.2	1.2	2,726	
オークマ	1.2	1.2	6,036	
アマダ	6	6	5,592	
小松製作所	6	6	14,460	
住友重機械工業	1.2	1.2	2,734	
日立建機	6	6	16,218	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
クボタ	6	6	11,106
荏原製作所	1.2	1.2	3,526
ダイキン工業	6	6	117,870
日本精工	6	6	5,154
NTN	6	6	1,188
ジェイテクト	6	6	5,082
日立造船	1.2	1.2	507
三菱重工業	0.6	0.6	1,362
IHI	0.6	0.6	777
電気機器 (20.4%)			
日清紡ホールディングス	6	6	4,266
コニカミノルタ	6	6	1,572
ミネベアミツミ	6	6	11,802
日立製作所	1.2	1.2	4,438
三菱電機	6	6	8,391
富士電機	1.2	1.2	3,858
安川電機	6	6	24,720
オムロン	6	6	48,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1.2	1.2	2,252
日本電気	0.6	0.6	3,300
富士通	0.6	0.6	7,635
沖電気工業	0.6	0.6	622
セイコーエプソン	12	12	13,524
パナソニック	6	6	5,493
ソニー	6	6	52,800
TDK	6	6	75,480
アルプスアルパイン	6	6	9,480
横河電機	6	6	9,528
アドバンテスト	12	12	66,240
カシオ計算機	6	6	9,552
ファナック	6	6	128,190
京セラ	12	12	76,368
太陽誘電	6	6	23,490
S C R E E Nホールディングス	1.2	1.2	7,188
キヤノン	9	9	16,465
リコー	6	6	4,176
東京エレクトロン	6	6	173,970
輸送用機器 (4.1%)			
デンソー	6	6	29,856
三井E&Sホールディングス	0.6	0.6	208
川崎重工業	0.6	0.6	782
日産自動車	6	6	2,255
いすゞ自動車	3	3	2,597
トヨタ自動車	6	6	41,358
日野自動車	6	6	4,722
三菱自動車工業	0.6	0.6	121
マツダ	1.2	1.2	680
本田技研工業	12	12	29,796
スズキ	6	6	26,916
S U B A R U	6	6	11,964
ヤマハ発動機	6	6	9,228
精密機器 (3.8%)			
テルモ	24	24	94,032
ニコン	6	6	3,900
オリンパス	24	24	47,172

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
シチズン時計	6	6	1,662
その他製品 (2.3%)			
バンダイナムコホールディングス	6	6	48,072
凸版印刷	3	3	4,074
大日本印刷	3	3	6,009
ヤマハ	6	6	29,640
電気・ガス業 (0.2%)			
東京電力ホールディングス	0.6	0.6	167
中部電力	0.6	0.6	722
関西電力	0.6	0.6	587
東京瓦斯	1.2	1.2	2,754
大阪瓦斯	1.2	1.2	2,322
陸運業 (1.7%)			
東武鉄道	1.2	1.2	3,592
東急	3	3	3,756
小田急電鉄	3	3	7,512
京王電鉄	1.2	1.2	7,272
京成電鉄	3	3	9,015
東日本旅客鉄道	0.6	0.6	3,361
西日本旅客鉄道	0.6	0.6	2,770
東海旅客鉄道	0.6	0.6	7,800
日本通運	0.6	0.6	3,516
ヤマトホールディングス	6	6	16,926
海運業 (0.1%)			
日本郵船	0.6	0.6	1,177
商船三井	0.6	0.6	1,416
川崎汽船	0.6	0.6	772
空運業 (0.0%)			
ANAホールディングス	0.6	0.6	1,386
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	3	3	8,286
情報・通信業 (12.9%)			
ネクソン	—	12	35,148
Zホールディングス	2.4	2.4	1,778
トレンドマイクロ	6	6	35,280
スカパーJ SATホールディングス	0.6	0.6	272
日本電信電話	1.2	2.4	5,308
KDDI	36	36	99,540
ソフトバンク	—	6	7,299
NTTドコモ	0.6	0.6	2,332
東宝	0.6	0.6	2,562
エヌ・ティ・ティ・データ	30	30	36,510
コナミホールディングス	6	6	25,080
ソフトバンクグループ	36	36	248,652
卸売業 (1.7%)			
双日	0.6	0.6	139
伊藤忠商事	6	6	15,180
丸紅	6	6	3,366
豊田通商	6	6	17,124
三井物産	6	6	10,440
住友商事	6	6	7,038
三菱商事	6	6	14,280
小売業 (12.7%)			
J. フロント リテイリング	3	3	2,373
三越伊勢丹ホールディングス	6	6	3,108
セブン&アイ・ホールディングス	6	6	19,482
ファミリーマート	24	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
高島屋	3	3	2,406
丸井グループ	6	6	11,544
イオン	6	6	16,137
ファーストリテイリング	6	6	438,720
銀行業 (0.5%)			
コンコディア・フィナンシャルグループ	6	6	2,106
新生銀行	0.6	0.6	762
あおぞら銀行	0.6	0.6	1,045
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6	6	2,469
りそなホールディングス	0.6	0.6	205
三井住友トラスト・ホールディングス	0.6	0.6	1,684
三井住友フィナンシャルグループ	0.6	0.6	1,734
千葉銀行	6	6	3,270
ふくおかフィナンシャルグループ	1.2	1.2	2,118
静岡銀行	6	6	4,248
みずほフィナンシャルグループ	6	0.6	768
証券・商品先物取引業 (0.3%)			
大和証券グループ本社	6	6	2,684
野村ホールディングス	6	6	2,850
松井証券	6	6	5,052
保険業 (0.7%)			
SOMPOホールディングス	1.5	1.5	5,910
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	1.8	1.8	5,194
ソニーフィナンシャルホールディングス	1.2	-	-
第一生命ホールディングス	0.6	0.6	944
東京海上ホールディングス	3	3	14,139
T & Dホールディングス	1.2	1.2	1,267

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
その他金融業 (0.6%)				
クレディセゾン	6	6	6,912	
日本取引所グループ	-	6	15,744	
不動産業 (1.1%)				
東急不動産ホールディングス	6	6	2,808	
三井不動産	6	6	10,773	
三菱地所	6	6	9,390	
東京建物	3	3	3,666	
住友不動産	6	6	16,893	
サービス業 (6.9%)				
エムスリー	14.4	14.4	102,096	
ディー・エヌ・エー	1.8	1.8	3,308	
電通グループ	6	6	18,060	
サイバーエージェント	1.2	1.2	7,728	
楽天	6	6	6,300	
リクルートホールディングス	18	18	72,936	
日本郵政	6	6	4,358	
セコム	6	6	53,760	
合 計	株 数 ・ 金 額	千株	千株	千円
	銘柄数 <比率>	1,076.1	1,083.3	3,882,108
		225銘柄	225銘柄	<96.4%>

(注1) 銘柄欄の()内は、期末の国内株式評価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。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国内	百万円 139	百万円 -
日 経 平 均		

■投資信託財産の構成

2020年10月29日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 3,882,108	% 94.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	208,173	5.1
投 資 信 託 財 産 総 額	4,090,282	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

(2020年10月29日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	4,090,051,857円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	120,339,897
株 式 (評価額)	3,882,108,420
未 収 入 金	56,308,100
未 収 配 当 金	26,035,440
差 入 委 託 証 拠 金	5,260,000
(B) 負 債	62,896,640
未 払 金	35,255,640
未 払 解 約 金	27,641,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	4,027,155,217
元 本	2,591,157,263
次 期 繰 越 損 益 金	1,435,997,954
(D) 受 益 権 総 口 数	2,591,157,263口
1 千 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	1,554円

- (注1) 期首元本額 2,822,485,517円
 追加設定元本額 76,772,667円
 一部解約元本額 308,100,921円
- (注2) 期末における元本の内訳
 インデックスミリオン 2,358,849,945円
 ボンドミックスミリオン 232,307,318円
 期末元本合計 2,591,157,263円

■損益の状況

当期 自2019年10月30日 至2020年10月29日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	69,440,769円
受 取 配 当 金	69,564,804
そ の 他 収 益 金	7,671
支 払 利 息	△131,706
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	60,181,272
売 買 益	428,060,832
売 買 損	△367,879,560
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	16,227,410
取 引 益	73,052,620
取 引 損	△56,825,210
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	145,849,451
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,414,260,249
(F) 解 約 差 損 益 金	△147,153,079
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	23,041,333
(H) 合 計(D+E+F+G)	1,435,997,954
次 期 繰 越 損 益 金(H)	1,435,997,954

- (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) (F)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) (G)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。