

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

償還運用報告書(全体版)

〈繰上償還〉

第35期(信託終了日 2022年 2月14日)

受益者のみなさまへ

平素は「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」にご投資いただき、厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、信託約款の規定に基づき、償還の手続きを行い、2022年2月14日に繰上償還いたしました。

ここに謹んで運用経過と償還内容をご報告申し上げます。

長い間ご愛顧賜り、厚くお礼申し上げます。

 明治安田アセットマネジメント株式会社

東京都千代田区大手町二丁目3番2号
ホームページ <https://www.myam.co.jp/>

〈運用報告書のお問い合わせ先〉

サポートデスク 0120-565787
(受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

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	1987年11月27日から2022年2月14日(当初、無期限)までです。	
運用方針	信託財産の成長をはかることを目的として、運用を行います。	
主要運用対象	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	ミリオン・インデックスマザーファンド受益証券およびわが国の金融商品取引所上場株式の中から金融関連株として選定した銘柄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	わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均株価(225種)に採用されている銘柄を投資対象とします。
組入制限	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	マザーファンド受益証券および株式への投資には制限を設けません。また、外貨建資産への投資は行いません。
	ミリオン・インデックスマザーファンド	株式への投資には制限を設けません。また、外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	分配対象額の範囲は、利子・配当収入と売買益(評価益を含みます。)等の合計額とし、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。	

◎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	(参考指数)	期中 騰落率			
(第31期) 2018年11月19日	円 7,189	円 0	% △ 2.5	円 21,821.16	% △ 2.6	% 93.6	% 2.4	百万円 228
(第32期) 2019年11月18日	7,497	0	4.3	23,416.76	7.3	96.9	—	199
(第33期) 2020年11月17日	7,787	0	3.9	26,014.62	11.1	96.8	—	193
(第34期) 2021年11月17日	9,084	0	16.7	29,688.33	14.1	96.1	—	208
(償還時) (第35期) 2022年 2月14日	(償還価額) 9,085.54	—	0.0	27,079.59	△ 8.8	—	—	187

(注1) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「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) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

(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、日経平均株価自体及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。株式会社日本経済新聞社は、当ファンドの運用成果等に関し一切責任はありません。

◎当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		株式組入率	株式先物比率
		騰落率	(参考指数)	騰落率		
(期首) 2021年 11月17日	円 9,084	% —	円 29,688.33	% —	% 96.1	% —
11月末	8,553	△5.8	27,821.76	△6.3	96.4	—
12月末	8,896	△2.1	28,791.71	△3.0	97.1	—
2022年 1月末	9,092	0.1	27,001.98	△9.0	—	—
(償還時) 2022年 2月14日	(償還価額) 9,085.54	0.0	27,079.59	△8.8	—	—

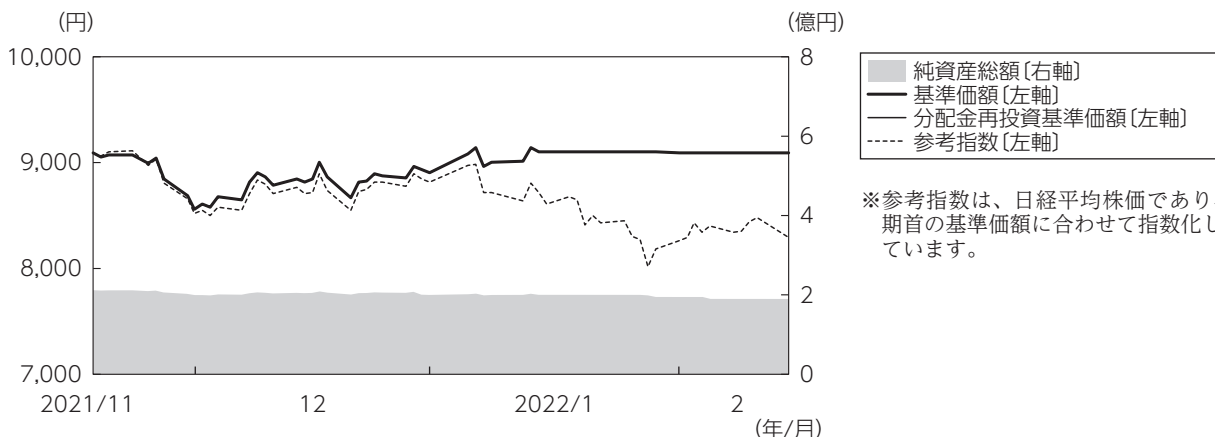
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「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) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎当期の運用経過

■基準価額等の推移



第35期首(2021年11月17日)：9,084円
 償還時(2022年2月14日)：9,085円54銭(既払分配金－円)
 騰落率：0.0%(分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は分配金実績があった場合、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。

※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。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。

■基準価額の主な変動要因

ファンドの運用方針に従い、マザーファンドを通じて、日経平均株価(225種)採用銘柄に投資するとともに、わが国の金融商品取引所上場株式の中から金融関連株として選定した銘柄に直接投資を行いました。投資対象資産の価格変動等による基準価額の変動要因は以下の通りとなりました。

(上昇要因)

- ・12月初旬から2022年1月初旬にかけて新型コロナウイルスの新たな変異株の影響は限定的との見方や、良好な米国経済指標を好感し、国内株式相場が上昇したこと

(下落要因)

- ・期首から11月下旬にかけて、海外で新型コロナウイルスの新たな変異株の感染が拡大したことを受け、国内での感染拡大の警戒感から国内株式相場が大きく下落したこと

■投資環境

当期の国内株式相場は下落しました。期首から11月下旬にかけて、海外で新型コロナウイルスの新たな変異株の感染が拡大したことを受けて、国内景気の減速懸念が高まり大きく下落しました。その後2022年1月初旬にかけては、同変異株の影響は限定的との見方や、良好な米国経済指標を好感し、上昇に転じましたが、期末にかけては同変異株の国内における感染急拡大やウクライナ情勢の緊迫化、米国において1月下旬のFOMC（米連邦公開市場委員会）後は金融政策正常化のペースが加速するとの見方が広がったこともあり、軟調に推移しました。

■当該投資信託のポートフォリオ

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

期首の運用方針に基づき、ミリオン・インデックスマザーファンドを通じて日経平均株価採用銘柄に投資するとともに、金融関連株として選定した銘柄に直接投資することにより、信託財産の成長をはかることを目的として運用を行いました。追加設定・解約に伴う資産の増減に対して、マザーファンドおよび金融関連株の売買を行うことにより、株式の実質的な組入比率を高位に保ちました。金融関連株の組入比率は概ね30%程度の水準を維持し、時価総額、業種構成、信用リスク等を考慮したポートフォリオを継続しました。

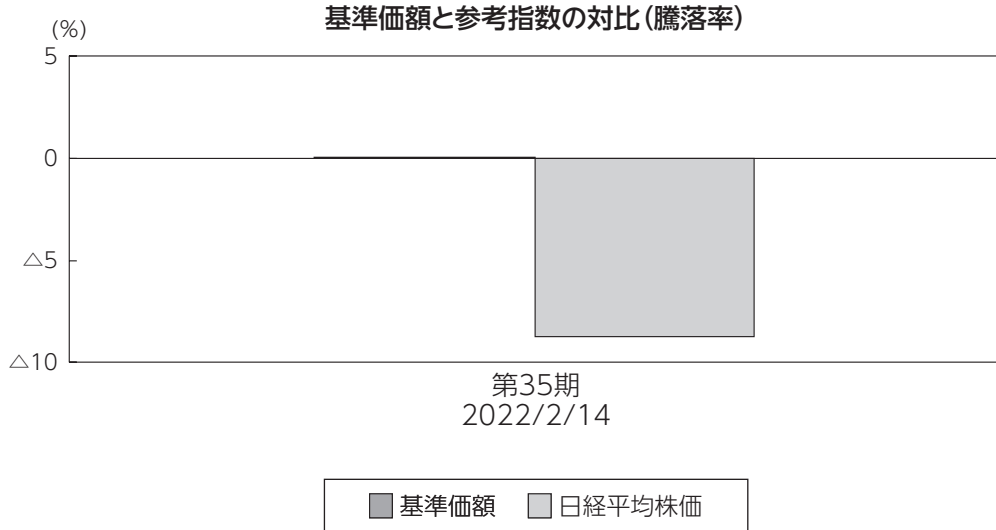
なお、償還を控え、2022年1月中旬にマザーファンドおよび金融関連株をすべて売却しました。

ミリオン・インデックスマザーファンド

期首の運用方針に基づき、日経平均株価に連動した収益の獲得を目指して運用を行いました。当期においては、追加設定および解約に伴う資金の流出入等に伴い、株式の売買を行い、株式と株式先物を合計した実質的な株式組入比率は、高位を維持しました。加えて、信用リスクに対する懸念の高まりを受けてポートフォリオから除外していた東京電力ホールディングスについては非保有を継続したほか、日本軽金属ホールディングス、みずほフィナンシャルグループおよび、双日においてはファンド規模を勘案の上、非保有を継続しました。

なお、償還を控え、2022年1月中旬に組入株式をすべて売却しました。

■当該投資信託のベンチマークとの差異



当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。
 上記グラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。当期の基準価額の騰落率は+0.0%となりました。参考指数の騰落率は△8.8%となりました。

◎設定以来の運用経過(1987年11月27日～2022年2月14日)

基準価額と収益分配金



※分配金再投資基準価額は分配金実績があった場合、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。

※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。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。

※参考指数は日経平均株価であり、設定時の基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額は、設定時10,000円で始まり償還日9,085円54銭で終わりました。騰落率(分配金再投資ベース)は△8.3%でした。設定以来お支払した分配金(税込み)は1万口当たり65円でした。なお、収益分配にあてず信託財産内に留保した利益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行いました。

基準価額の主な変動要因

ファンドの運用方針に従い、マザーファンドを通じて、日経平均株価(225種)採用銘柄に投資するとともに、わが国の金融商品取引所上場株式の中から金融関連株として選定した銘柄に直接投資を行いました。投資対象資産の価格変動等による基準価額の変動要因は以下の通りとなりました。

投資対象資産の価格変動等による基準価額の変動要因は以下の通りとなりました。

(上昇要因)

- ・設定時から1989年12月にかけて順調な経済成長を背景に不動産価格が高騰し、それに連動して株式を買う動きが強まったこと
- ・2003年5月から2007年7月にかけて首相による構造改革路線への期待などから外国人投資家を中心に株式を買う動きが強まったこと
- ・2012年12月から2019年12月にかけて「アベノミクス」によるデフレ脱却期待、米国政権による大型減税などの政策期待に加え、世界的に景気が回復し国内株式相場が上昇したこと

- ・2020年4月から償還にかけて新型コロナウイルスの感染拡大を受けた各国地域による金融緩和や経済対策に加えて、ワクチン普及に伴う経済活動の再開期待などから株式を買う動きが強まったこと

(下落要因)

- ・1990年1月から2003年4月にかけて不動産取引等への規制強化、金融引き締め、金融機関の不良債権問題および相次ぐ大手金融機関の経営破綻に加えて、米国における同時多発テロや同国大手企業の不正会計による経営破綻などから株式相場が下落したこと
- ・2007年8月から2009年3月にかけてサブプライムローン問題や「リーマン・ショック」により金融システム不安が高まり、株式相場が下落したこと
- ・2020年1月から3月にかけて新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて景気減速懸念が高まったことから株式相場が下落したこと

運用概況

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

運用方針に基づき、ミリオン・インデックスマザーファンドを通じて日経平均株価採用銘柄に投資するとともに、金融関連株として選定した銘柄に直接投資することにより、信託財産の成長をはかることを目的として運用を行いました。追加設定・解約に伴う資産の増減に対して、マザーファンドおよび金融関連株の売買を行うことにより、株式の実質的な組入比率を高位に保ちました。金融関連株の組入比率は概ね30%程度の水準を維持し、時価総額、業種構成、信用リスク等を考慮したポートフォリオを継続しました。

ミリオンインデックスマザーファンド

後述の同マザーファンドの運用報告書をご参照ください。

◎1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年11月18日～2022年2月14日)		
	金額	比率	
(a)信託報酬	38 円	0.429 %	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×期末の信託報酬率 ※期中の平均基準価額は8,847円です。
(投信会社)	(10)	(0.113)	ファンドの運用、基準価額の算出、法定書類の作成等の対価
(販売会社)	(26)	(0.295)	購入後の情報提供、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)	(2)	(0.021)	ファンド財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b)売買委託手数料	1	0.006	(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)	(1)	(0.006)	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
(c)その他費用	1	0.008	(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係る費用
(その他)	(1)	(0.006)	信託事務の処理等に要する諸費用、信託財産に関する租税等
合 計	40	0.443	

(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・解約により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、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

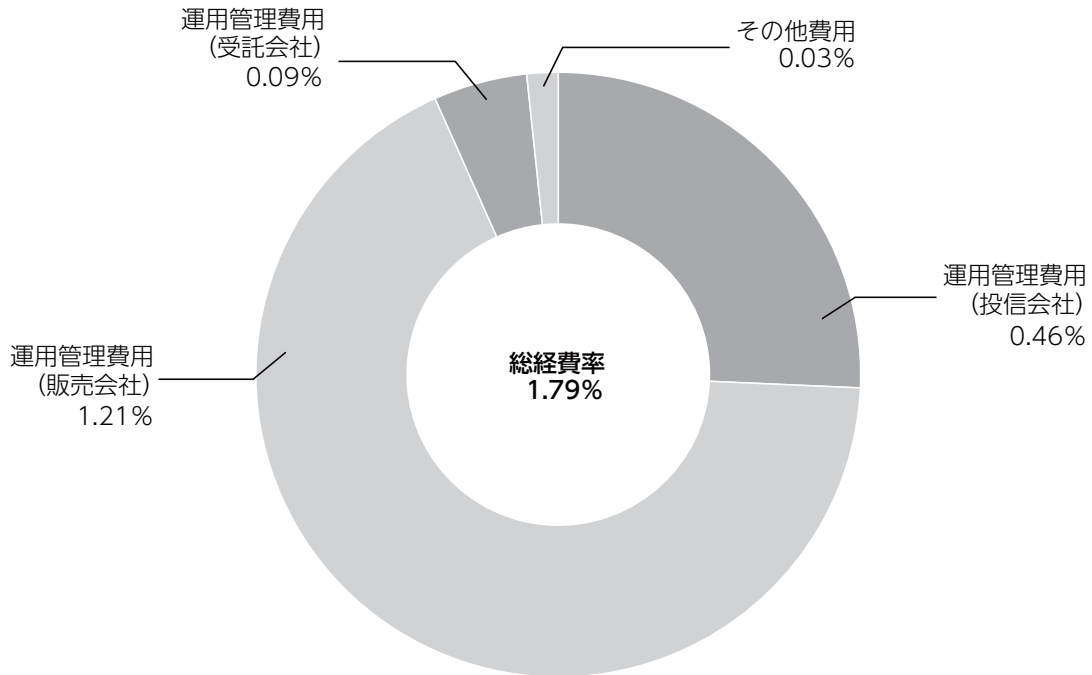
(注2)消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3)各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注4)各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報) 総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）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1.79%です。



(注) 費用は、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) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 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は異なります。

◎売買及び取引の状況 (2021年11月18日～2022年2月14日)

○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
		—	—	49	64,938

(注1)金額は受渡し代金。
(注2)単位未満は切り捨て。

○親投資信託の設定、解約状況

	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	千円	千口	千円
	—	—	77,501	139,691

(注)単位未満は切り捨て。

◎株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期	
	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	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	64,938千円	530,770千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	56,360千円	522,425千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.15	1.01

(注)(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

◎利害関係人との取引状況等 (2021年11月18日～2022年2月14日)

期中の利害関係人との取引はございません。

(注)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す。

◎組入資産明細表

2022年2月14日現在、有価証券等の組み入れはございません。

○国内株式
上場株式

銘柄	期首株数	首数
		千株
銀行業		
コンコルディア・フィナンシャルグループ	2.1	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	23.2	
りそなホールディングス	3.8	
三井住友トラスト・ホールディングス	0.6	
三井住友フィナンシャルグループ	2.3	
みずほフィナンシャルグループ	4.6	
証券、商品先物取引業		
大和証券グループ本社	2.5	
野村ホールディングス	5.2	
保険業		
SOMPOホールディングス	0.6	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	0.8	
東京海上ホールディングス	1.1	
T & Dホールディングス	1	
その他金融業		
オリックス	2.1	
合計		49
		13

○親投資信託残高

種類	期首	償還時	
	口数	口数	評価額
ミリオン・インデックス マザーファンド	千口 77,501	千口 -	千円 -

(注)口数・評価額の単位未満は切り捨て。

◎投資信託財産の構成

2022年2月14日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	187,979	100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	187,979	100.0

(注)評価額の単位未満は切り捨て。

◎資産、負債、元本及び償還価額の状況

2022年2月14日現在

項 目	償 還 時
(A)資 産	187,979,577円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	187,979,577
(B)負 債	859,793
未 払 信 託 報 酬	851,492
そ の 他 未 払 費 用	8,301
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	187,119,784
元 本	205,953,302
償 還 差 損 金	△ 18,833,518
(D)受 益 権 総 口 数	205,953,302口
1 万 口 当 たり 償 還 価 額 (C / D)	9,085円54銭

◎損益の状況

自 2021年11月18日
至 2022年 2月14日

項 目	当 期
(A)配 当 等 収 益	16,475円
受 取 配 当 金	16,475
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	883,181
売 買 益	6,677,327
売 買 損	△ 5,794,146
(C)信 託 報 酬 等	△ 860,330
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	39,326
(E)前 期 繰 越 損 益 金	56,907,642
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	△ 75,780,486
(配 当 等 相 当 額)	(39,124,546)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△114,905,032)
償 還 差 損 金 (D + E + F)	△ 18,833,518

(注1)当ファンドの期首元本額は230,050,651円、期中追加設定元本額は275,596円、期中一部解約元本額は24,372,945円です。

(注2)1口当たり純資産額は0.908554円です。

(注3)純資産総額が元本額を下回っており、その額は18,833,518円です。

(注4)損益の状況の中で(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5)損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬等に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注6)損益の状況の中で(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。

◎投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	1987年11月27日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2022年 2月14日		資産総額	187,979,577円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減又は追加信託	負債総額	859,793円
				純資産総額	187,119,784円
受益権口数	154,779,118口	205,953,302口	51,174,184口	受益権口数	205,953,302口
元本額	154,779,118円	205,953,302円	51,174,184円	1万口当たり償還金	9,085.54円
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金額	分配率
	円	円	円	円	%
第25期	604,673,299	197,894,887	3,273	0	0.0000
第26期	499,515,602	276,779,970	5,541	0	0.0000
第27期	470,874,084	278,341,061	5,911	0	0.0000
第28期	439,125,001	301,975,101	6,877	0	0.0000
第29期	436,582,318	270,448,498	6,195	0	0.0000
第30期	350,423,762	258,414,663	7,374	0	0.0000
第31期	317,174,145	228,010,631	7,189	0	0.0000
第32期	265,577,241	199,094,965	7,497	0	0.0000
第33期	248,685,910	193,641,596	7,787	0	0.0000
第34期	230,050,651	208,974,986	9,084	0	0.0000

◎償還金のお知らせ

1万口当たり償還金(税込み)	9,085円54銭
----------------	-----------

※償還金は、償還日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

ミリオン・インデックスマザーファンド

償還運用報告書

第35期〈繰上償還〉

(信託終了日 2022年2月10日)

「ミリオン・インデックスマザーファンド」は、2022年2月10日に繰上償還いたしました。
以下、償還までの運用状況をご報告申し上げます。

当マザーファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	日経平均株価(225種)に連動した収益を目指して運用を行います。
主要運用対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均株価(225種)に採用されている銘柄を投資対象とします。
組入制限	株式への投資には制限を設けません。また、外貨建資産への投資は行いません。

◎最近5期の運用実績

決算期	基準価額		日経平均株価		株式組入率	株式先比率	純資産総額
	円	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率			
(第31期) 2018年11月19日	1,312	△ 0.5	21,821.16	△ 2.6	93.9	3.5	百万円 620
(第32期) 2019年11月18日	1,434	9.3	23,416.76	7.3	99.0	—	602
(第33期) 2020年11月17日	1,618	12.8	26,014.62	11.1	99.1	—	574
(第34期) 2021年11月17日	1,877	16.0	29,688.33	14.1	97.9	—	565
(償還時) (第35期) 2022年 2月10日	(償還価額) 1,800.89	△ 4.1	27,696.08	△ 6.7	—	—	515

(注1) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注2) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

(注3) 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、日経平均株価自体及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。株式会社日本経済新聞社は、当ファンドの運用成果等に関し一切責任はありません。

◎当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		株式組入率	株式先物比率
	円	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
(期首) 2021年 11月 17日	1,877	—	29,688.33	—	97.9	—
11月 末	1,761	△6.2	27,821.76	△6.3	98.5	—
12月 末	1,825	△2.8	28,791.71	△3.0	99.0	—
2022年 1月 末	1,801	△4.0	27,001.98	△9.0	—	—
(償還時) 2022年 2月 10日	(償還価額) 1,800.89	△4.1	27,696.08	△6.7	—	—

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎設定以来の運用経過(1987年11月27日～2022年2月10日)

1 基準価額

基準価額の推移と主な変動要因



※基準価額は、入手し得る2001年1月10日からのデータを掲載しております。

※ベンチマークは日経平均株価です。

基準価額は設定時1,000円で始まり償還日1,800円89銭で終わりました。騰落率は+80.1%でした。基準価額の主な変動要因は以下の通りです。

(上昇要因)

- ・ 設定時から1989年12月にかけて順調な経済成長を背景に不動産価格が高騰し、それに連動して株式を買う動きが強まったこと
- ・ 2003年5月から2007年7月にかけて首相による構造改革路線への期待などから外国人投資家を中心に株式を買う動きが強まったこと
- ・ 2012年12月から2019年12月にかけて「アベノミクス」によるデフレ脱却期待、米国政権による大型減税などの政策期待に加え、世界的に景気が回復し国内株式相場が上昇したこと
- ・ 2020年4月から償還にかけて新型コロナウイルスの感染拡大を受けた各国地域による金融緩和や経済対策に加えて、ワクチン普及に伴う経済活動の再開期待などから株式を買う動きが強まったこと

(下落要因)

- ・ 1990年1月から2003年4月にかけて不動産取引等への規制強化、金融引き締め、金融機関の不良債権問題および相次ぐ大手金融機関の経営破綻に加えて、米国における同時多発テロや同国大手企業の不正会計による経営破綻などから株式相場が下落したこと
- ・ 2007年8月から2009年3月にかけてサブプライムローン問題や「リーマン・ショック」により金融システム不安が高まり、株式相場が下落したこと
- ・ 2020年1月から3月にかけて新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて景気減速懸念が高まったことから株式相場が下落したこと

当該投資信託のベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は+80.1%になりました。一方、ベンチマークの騰落率は+19.0%となり、騰落率の差異は+61.1%でした。この差異に関する主な要因は以下の通りです。

- ・ 保有株式に係る配当金を計上したこと（特に毎年3月、9月）

2 運用経過

運用概況

運用方針に基づき、日経平均株価に連動した収益の獲得を目指して運用を行いました。追加設定および解約に伴う資金の流出入や日経平均株価の採用銘柄の入れ替え等に対し、株式の売買を行い、株式と株式先物を合計した実質的な株式組入比率は高位を維持しました。株式の組み入れについては原則として日経平均株価の採用銘柄を対象に日経平均株価の計算方法に基づいて実施しました。また、同計算方法による株式の投資単位に満たない資金については、日経平均先物を組み入れました。なお、信用リスクに対する懸念の高まりなどから日経平均株価の採用銘柄の一部を非保有とした場面がありました。

◎1千口当たりの費用明細

項目	当期 (2021年11月18日～2022年2月10日)		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0 円	0.006 %	(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、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 ※期中の平均基準価額は1,795円です。
(株式)	(0)	(0.006)	
(b) その他費用	0	0.008	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(その他)	(0)	(0.008)	信託事務の処理等に要する諸費用、信託財産に関する租税等
合 計	0	0.014	

(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・解約により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。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 各比率は千口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

◎売買及び取引の状況 (2021年11月18日～2022年2月10日)

○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
		—	—	117	530,770

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切り捨て。

○先物取引の種類別取引状況

該当事項はございません。

◎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	530,770千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	522,425千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	1.01

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

◎利害関係人との取引状況等 (2021年11月18日～2022年2月10日)

期中の利害関係人との取引はございません。

(注) 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す。

◎組入資産明細表

2022年2月10日現在、有価証券等の組み入れはございません。

○国内株式
 上場株式

銘	柄	期	首
		株	数
		千株	
水産・農林業			
日本水産		0.6	
マルハニチロ		0.1	
鉱業			
INPEX		0.3	
建設業			
コムシスホールディングス		0.6	
大成建設		0.1	
大林組		0.6	
清水建設		0.6	
長谷工コーポレーション		0.1	
鹿島建設		0.3	
大和ハウス工業		0.6	
積水ハウス		0.6	
日揮ホールディングス		0.6	
食料品			
日清製粉グループ本社		0.6	
明治ホールディングス		0.1	
日本ハム		0.3	
サッポロホールディングス		0.1	
アサヒグループホールディングス		0.6	
キリンホールディングス		0.6	
宝ホールディングス		0.6	
キッコーマン		0.7	
味の素		0.6	
ニチレイ		0.3	
日本たばこ産業		0.6	
繊維製品			
東洋紡		0.1	
ユニチカ		0.1	
帝人		0.1	
東レ		0.6	
パルプ・紙			
王子ホールディングス		0.6	
日本製紙		0.1	
化学			
クラレ		0.6	
旭化成		0.6	
昭和電工		0.1	
住友化学		0.6	
日産化学		0.6	

銘	柄	期	首
		株	数
		千株	
東ソ			0.3
トクヤマ			0.1
デンカ			0.1
信越化学工業			0.7
三井化学			0.1
三菱ケミカルホールディングス			0.3
宇部興産			0.1
花王			0.6
DI			0.1
富士フィルムホールディングス			0.7
資生堂			0.6
日東電工			0.7
医薬品			
協和キリン			0.6
武田薬品工業			0.6
アステラス製薬			3.2
大日本住友製薬			0.6
塩野義製薬			0.6
中外製薬			1.9
エーザイ			0.7
第一三共			1.9
大塚ホールディングス			0.6
石油・石炭製品			
出光興産			0.3
ENEOSホールディングス			0.6
ゴム製品			
横浜ゴム			0.3
ブリヂストン			0.6
ガラス・土石製品			
AG			C 0.1
日本板硝子			0.1
日本電気硝子			0.1
住友大阪セメント			0.1
太平洋セメント			0.1
東海カーボ			0.6
TO			O 0.3
日本碍子			0.6
鉄鋼			
日本製鉄			0.1
神戸製鋼所			0.1
ジェイエフイーホールディングス			0.1

銘柄		期株	首数
			千株
非鉄金属	大平洋金属	0.1	
	三井金属鉱業	0.1	
	東邦亜鉛	0.1	
	三菱マテリア	0.1	
	住友金属鉱山	0.3	
	DOWAホールディングス	0.1	
	古河電気工業	0.1	
	住友電気工業	0.6	
	フジクラ	0.6	
金属製品	SUMICO	0.1	
機械	日本製鋼所	0.1	
	オーケー	0.1	
	アマダ	0.6	
	小松製作所	0.6	
	住友重機械工業	0.1	
	日立建機	0.6	
	クボタ	0.6	
	荏原製作所	0.1	
	ダイキン工業	0.7	
	日本精工	0.6	
	NTN	0.6	
	ジェイテクト	0.6	
	三井E&Sホールディングス	0.1	
	日立造船	0.1	
	三菱重工	0.1	
	IHI	0.1	
電気機器	コニカミノルタ	0.6	
	ミネベアミツミ	0.6	
	日立製作所	0.1	
	三菱電機	0.6	
	富士電機	0.1	
	安川電機	0.6	
	オムロン	0.7	
	ジーエス・ユアサコーポレーション	0.1	
	日本電気	0.1	
	富士通	0.1	
	沖電気工業	0.1	
	セイコーエプソン	1.3	
	パナソニック	0.6	
	シャープ	0.6	
	ソニー	0.7	
	TDK	2.1	

銘柄		期株	首数
			千株
	アルプスアルパイン	0.6	
	横河電機	0.6	
	アドバンテス	1.3	
	キーエンス	0.1	
	カシオ計算機	0.6	
	ファナック	0.7	
	京セラ	1.3	
	太陽誘電	0.6	
	村田製作所	0.5	
	SCREENホールディングス	0.1	
	キヤノノ	1	
	リコー	0.6	
	東京エレクトロン	0.7	
輸送用機器	デンソー	0.6	
	川崎重工	0.1	
	日産自動車	0.6	
	いすゞ自動車	0.3	
	トヨタ自動車	3.5	
	日野自動車	0.6	
	三菱自動車工業	0.1	
	マツダ	0.1	
	本田技研工業	1.3	
	スズキ	0.6	
	SUBARU	0.6	
	ヤマハ発動機	0.6	
精密機器	テルモ	2.6	
	ニコン	0.6	
	オリオンパス	2.6	
	シチズン時計	0.6	
その他製品	バンダイナムコホールディングス	0.6	
	凸版印刷	0.3	
	大日本印刷	0.3	
	ヤママ	0.6	
	任天堂	0.1	
電気・ガス業	中部電力	0.1	
	関西電力	0.1	
	東京瓦斯	0.1	
	大阪瓦斯	0.1	
陸運業	東武鉄道	0.1	
	東急	0.3	
	小田急電鉄	0.3	

銘	柄	期	首					
		株	数					
			千株					
京	王	電	鉄	0.1				
京	成	電	鉄	0.3				
東	日	本	旅	客	鉄	道	0.1	
西	日	本	旅	客	鉄	道	0.1	
東	海	旅	客	鉄	道	0.1		
日	本	通	運	0.1				
海	ヤマト	ホ	ール	ディ	ング	ス	0.6	
		運	業					
日	本	郵	船	0.1				
商	船	三	井	0.1				
川	崎	汽	船	0.1				
空		運	業					
A	N	A	ホ	ール	ディ	ング	ス	0.1
倉	庫	・	運	輸	関	連	業	
三	菱	倉	庫	0.3				
情	報	・	通	信	業			
ネ	ク	ソ	ン	1.3				
Z	ホ	ール	ディ	ング	ス	0.3		
ト	レ	ン	ド	マ	イ	ク	ロ	0.6
日	本	電	信	電	話	0.1		
K	D	D	I	3.9				
ソ	フ	ト	バ	ン	ク	0.6		
東			宝	0.1				
エ	ヌ	・	ティ	・	ティ	・	デー	3.2
コ	ナ	ミ	ホ	ール	ディ	ング	ス	0.6
ソ	フ	ト	バ	ン	ク	グ	ル	3.9
卸		売	業					
伊	藤	忠	商	事	0.6			
丸			紅	0.6				
豊	田	通	商	0.6				
三	井	物	産	0.6				
住	友	商	事	0.6				
三	菱	商	事	0.6				
小		売	業					
J	・	フ	ロ	ン	ト	リ	テイ	0.3
三	越	伊	勢	丹	ホ	ール	ディ	0.6
セ	ブ	ン	&	アイ	・	ホ	ール	0.6
高		島	屋	0.3				
丸	井	グ	ル	ー	プ	0.6		
イ		オ	ン	0.6				
フ	ァ	ース	ト	リ	テイ	リ	ング	0.7
銀		行	業					
コ	ン	コ	ル	ディア	・	フィ	ナン	0.6
新	生	銀	行	0.1				
あ	お	ぞ	ら	銀	行	0.1		
三	菱	U	F	J	フィ	ナン	シ	0.6

銘	柄	期	首					
		株	数					
			千株					
り	そ	な	ホ	ール	ディ	ング	ス	0.1
三	井	住	友	ト	ラ	ス	ト	0.1
三	井	住	友	フィ	ナン	シ	ヤ	0.1
千	業	銀	行	0.6				
ふ	く	お	か	フィ	ナン	シ	ヤ	0.1
静	岡	銀	行	0.6				
証	券	・	商	品	先	物	取	
大	和	証	券	グ	ル	ー	プ	0.6
野	村	ホ	ール	ディ	ング	ス	0.6	
松	井	証	券	0.6				
保		險	業					
S	O	M	P	O	ホ	ール	ディ	0.1
M	S	&	A	D	イン	シ	ュ	0.2
第	一	生	命	ホ	ール	ディ	ング	0.1
東	京	海	上	ホ	ール	ディ	ング	0.3
T	&	D	ホ	ール	ディ	ング	ス	0.1
そ	の	他	金	融	業			
ク	レ	デ	ィ	セ	ゾ	ン	0.6	
日	本	取	引	所	グ	ル	ー	0.6
不		動	産	業				
東	急	不	動	産	ホ	ール	ディ	0.6
三	井	不	動	産	0.6			
三	菱	地	所	0.6				
東	京	建	物	0.3				
住	友	不	動	産	0.6			
サ		ー	ビ	ス	業			
エ	ム	ス	リ	ー	1.6			
デ	ィ	ー	・	エ	ヌ	・	エ	0.2
電	通	グ	ル	ー	プ	0.6		
サイ	バ	ー	エ	ー	ジェ	ン	ト	0.1
楽	天	グ	ル	ー	プ	0.6		
リ	ク	ル	ー	ト	ホ	ール	ディ	1.9
日	本	郵	政	0.6				
セ		コ	ム	0.7				
合	計	株	数	117				
合	計	銘	柄	数	221			

○先物取引の銘柄別期末残高
該当事項はございません。

◎投資信託財産の構成

2022年2月10日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	515,265	100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	515,265	100.0

(注)評価額の単位未満は切り捨て。

◎資産、負債、元本及び償還価額の状況

2022年2月10日現在

項 目	償 還 時
(A)資 産	515,265,515円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	515,265,515
(B)負 債	43,818
そ の 他 未 払 費 用	43,818
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	515,221,697
元 本	286,093,320
償 還 差 益 金	229,128,377
(D)受 益 権 総 口 数	286,093,320口
1 千 口 当 た り 償 還 価 額 (C / D)	1,800円89銭

◎損益の状況

自 2021年11月18日
至 2022年 2月10日

項 目	当 期
(A)配 当 等 収 益	692,690円
受 取 配 当 金	692,500
そ の 他 収 益 金	190
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△ 23,031,388
売 買 益	14,107,968
売 買 損	△ 37,139,356
(C)信 託 報 酬 等	△ 44,585
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 22,383,283
(E)前 期 繰 越 損 益 金	264,202,141
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	819,619
(G)解 約 差 損 益 金	△ 13,510,100
償 還 差 益 金 (D + E + F + G)	229,128,377

(注1)当親ファンドの期首元本額は301,422,839円、期中追加設定元本額は1,020,381円、期中一部解約元本額は16,349,900円です。

(注2)当親ファンドの当期末元本の内訳は、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212,856,164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73,237,156円です。

(注3)1口当たり純資産額は1,80089円です。

(注4)損益の状況の中で(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5)損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬等に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注6)損益の状況の中で(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7)損益の状況の中で(G)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。