

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／資産複合	
信 託 期 間	1987年11月27日から、原則として無期限です。	
運 用 方 針	日経平均株価（225種）採用の株式とわが国の公社債等を実質的な主要投資対象とし、信託財産の成長と安定した収益の確保をはかることを目的として、運用を行います。	
主 要 投 資 対 象	当ファンド	ミリオン・インデックス マザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます。）の受益証券およびわが国の公社債等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）に採用された銘柄を主要投資対象とします。
投 資 制 限	当ファンド	マザーファンドの受益証券への投資は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。
	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。
分 配 方 針	毎年11月26日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、原則として、以下の方針に基づき、収益分配を行います。 分配対象収益の範囲は、繰越分を含めた利子収入と売買益等の全額とします。 委託会社が、基準価額水準・市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。 分配金は、税金を差し引いた後、決算日の基準価額で再投資します。 分配可能額が少額の場合や基準価額水準によっては、収益分配を行わないことがあります。	

運用報告書(全体版)

ミリオン
(従業員積立投資プラン)
bondミックスポートフォリオ

【2024年11月26日決算】

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。
皆様の「ミリオン（従業員積立投資プラン） bondミックスポートフォリオ」は、2024年11月26日に第37期決算を迎えましたので、期中の運用状況ならびに決算のご報告を申し上げます。
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。



〒104-0031 東京都中央区京橋2-2-1

お問い合わせは弊社投信営業部へ

フリーダイヤル ☎ 0120-048-214（営業日の9:00～17:00）

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。

【ホームページ】

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

※アクセスにかかる通信料はお客様のご負担となります。

○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			日経平均株価（225種）		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	債 券 組入比率	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 率	(参考指数)	期 騰 落 率	(参考指数)	期 騰 落 率				
	円	円	%	円	%	ポイント	%	%	%	%	百万円
33期(2020年11月26日)	13,055	5	6.9	26,537.31	13.5	—	—	51.3	8.3	31.4	135
34期(2021年11月26日)	13,590	5	4.1	28,751.62	8.3	—	—	55.4	2.0	34.2	124
35期(2022年11月28日)	13,352	5	△ 1.7	28,162.83	△ 2.0	—	—	52.2	2.0	35.1	119
36期(2023年11月27日)	14,767	5	10.6	33,447.67	18.8	—	—	54.5	2.2	34.1	121
37期(2024年11月26日)	16,191	5	9.7	—	—	68,551.34	—	57.6	1.2	35.8	134

(注) 基準価額および分配金（税引前）は 1 万口当たり、基準価額の騰落率は分配金（税引前）込み。

(注) 日経平均株価（225種）および日経平均トータルリターン・インデックスは当ファンドの参考指数であり、ベンチマークではありません。

(注) 2024年 2 月27日に日経平均株価（225種）から日経平均トータルリターン・インデックスに参考指数を変更いたしました。

(注) 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、株式組入比率および株式先物比率は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率＝買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

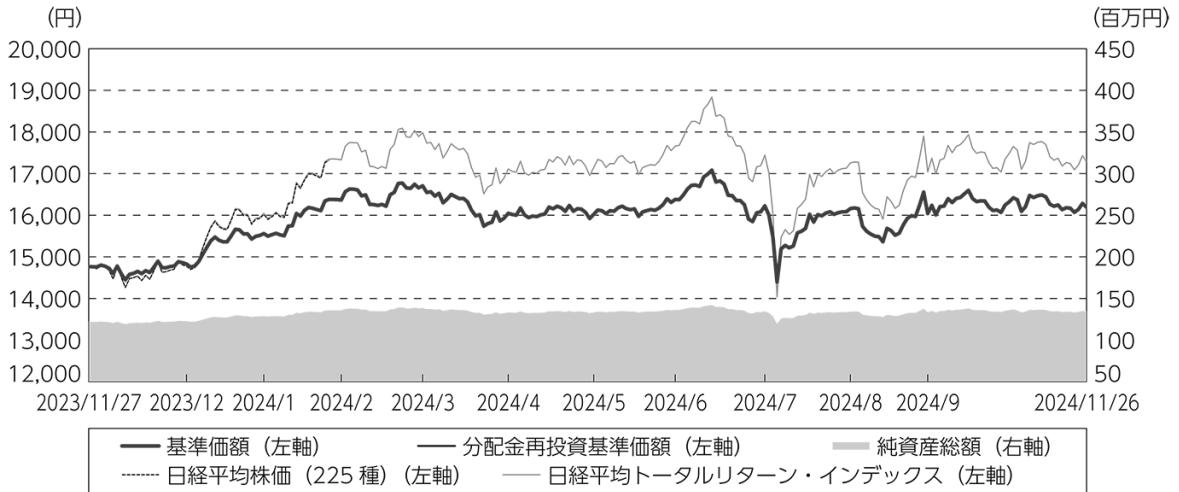
年 月 日	基 準 価 額		日経平均株価 (225種)		日 経 平 均 ト ー タ ル リターン・インデックス		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率			
(期 首)	円	%	円	%	ポイント	%	%	%	%
2023年11月27日	14,767	—	33,447.67	—	—	—	54.5	2.2	34.1
11月末	14,801	0.2	33,486.89	0.1	—	—	54.4	2.2	34.1
12月末	14,828	0.4	33,464.17	0.0	—	—	54.9	2.3	34.1
2024年 1 月末	15,559	5.4	36,286.71	8.5	—	—	58.5	1.2	32.4
2 月末	16,365	10.8	—	—	68,747.00	—	58.6	1.2	30.6
3 月末	16,706	13.1	—	—	71,346.41	—	60.0	1.2	30.0
4 月末	16,046	8.7	—	—	67,877.75	—	58.8	1.2	31.1
5 月末	16,023	8.5	—	—	68,023.40	—	58.6	1.2	30.9
6 月末	16,379	10.9	—	—	70,056.40	—	59.6	1.2	30.3
7 月末	16,225	9.9	—	—	69,208.61	—	57.7	1.2	32.1
8 月末	16,160	9.4	—	—	68,452.55	—	57.3	1.2	32.4
9 月末	16,041	8.6	—	—	67,604.81	—	57.3	1.2	32.6
10月末	16,371	10.9	—	—	69,678.38	—	57.8	1.2	32.0
(期 末)									
2024年11月26日	16,196	9.7	—	—	68,551.34	—	57.6	1.2	35.8

(注) 期末基準価額は 1 万口当たり分配金（税引前）込み、騰落率は期首比。

運用経過

期中の基準価額等の推移

(2023年11月28日～2024年11月26日)



期 首：14,767円

期 末：16,191円 (既払分配金(税引前)：5円)

騰落率： 9.7% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)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。
- (注) 参考指数は、日経平均株価(225種)および日経平均トータルリターン・インデックスです。
- (注) 分配金再投資基準価額および参考指数は、期首(2023年11月27日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 2024年2月27日に日経平均株価(225種)から日経平均トータルリターン・インデックスに参考指数を変更いたしました。そのため、日経平均株価(225種)の推移は2024年2月26日までを記載、日経平均トータルリターン・インデックスの推移は見やすさの観点から期首(2023年11月27日)より記載しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドの主な投資対象である「ミリオン・インデックス マザーファンド」におけるベンチマークに対する主なプラス要因およびマイナス要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ 特にありません。

(主なマイナス要因)

- ・ 「ミリオン・インデックス マザーファンド」においては、投資資金の増減および日経平均株価(225種)採用銘柄入れ替え時などに発生する株式や日経平均株価先物の売買コストなどがマイナス要因となりました。

また、当ファンドにおいては、組み入れた債券からの利息収入がプラス要因となる一方、信託報酬などのコストがマイナス要因となりました。

投資環境

（2023年11月28日～2024年11月26日）

国内株式市場は上昇しました。2024年3月にかけては、堅調な企業業績や増配、自己株式取得といった株主還元拡充への期待を背景に上昇しました。また、資本コストを意識した経営への変化を評価する海外投資家からの資金流入が継続したことも株価押し上げ要因となりました。その後は、為替市場での円安進行の一方で、米国の早期利下げ観測が後退したことや中東情勢の悪化などもあり一進一退の動きとなりました。8月以降は、低調な経済指標を受けて米国の景気悪化懸念が強まったことや、日銀が7月末に追加利上げを行い、今後の利上げに対して積極的な姿勢を示したことで円高や株安が一時急速に進行するなど、景気や企業業績に対する不透明感が強まり上下に振れの大きい動きとなりました。しかし、自民党総裁選挙や衆議院選挙、米大統領選挙などの重要な政治イベントを通過すると、株式市場は落ち着きを取り戻して期末を迎えました。

国内債券市場は長期国債利回りが上昇（債券価格が下落）しました。期初から2024年7月にかけては日銀による金融政策正常化への動きなどから長期国債利回りが大幅に上昇しました。8月には米国の景気悪化懸念を背景に海外債券利回りが大幅に低下したことを受けて、国内の長期国債利回りも低下（債券価格が上昇）しました。その後は、衆議院選挙において与党が過半数を割り込み、積極財政を掲げる国民民主党などとの連携の可能性や、日銀による追加利上げなどが意識され、長期国債利回りは再び上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

（2023年11月28日～2024年11月26日）

「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は、期を通じて50%～60%程度で推移させました。また、公社債への投資につきましては、プラスの利回りが確保でき、償還までの期間が比較的短く信用力の高い債券を組み入れ、安定収益の確保に努めました。公社債組入比率は、期を通じて30%台を保ちました。

「ミリオン・インデックス マザーファンド」の運用につきましては、運用の基本方針に則って日経平均トータルリターン・インデックスに連動する投資成果を目指して運用を行いました。具体的には、日経平均株価（225種）採用銘柄から財務リスクなどを考慮したポートフォリオを構築し、運用を行いました。また資金動向に柔軟に対応し、かつ株式組入比率を高水準に維持するため、日経平均株価先物を一部組み入れ、運用しました。追加設定・一部解約などの投資資金の増減に対しては、日経平均株価先物および組入銘柄の調整売買で対応しました。また、先物を含む株式組入比率は、期を通じて100%に近い高水準を維持しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

（2023年11月28日～2024年11月26日）

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。参考指数は、2024年2月26日までは日経平均株価（225種）でしたが、2024年2月27日以降は、日経平均トータルリターン・インデックスに変更いたしました。このため、当期中に参考指数が変更となったことからファンドとの比較ができないため、「基準価額と参考指数の対比（騰落率）」の掲載は行っておりません。

分配金

（2023年11月28日～2024年11月26日）

当期の分配は、1万口当たり5円（税引前）とさせていただきます。分配金は累積投資契約に基づき、税金を差し引いた後、全額再投資いたしました。なお、収益分配に充てなかった留保益につきましては、運用の基本方針と同一の運用を行ってまいります。

（単位：円、1万口当たり・税引前）

項 目	第37期
	2023年11月28日～ 2024年11月26日
当期分配金	5
（対基準価額比率）	0.031%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	9,354

（注）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）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

（注）当期の収益、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合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針

<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>

運用の基本方針に則り、主要な投資対象である「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50%～60%程度の水準に維持することにより売買益の獲得を図る一方、30%～40%程度を公社債等へ直接投資し、安定収益の確保に努めてまいります。

○ミリオン・インデックス マザーファンド

運用の基本方針に則り、先物を含む株式組入比率を高位に保ち、日経平均トータルリターン・インデックスと連動する投資成果を目指して運用してまいります。

○ 1 万口当たりの費用明細

（2023年11月28日～2024年11月26日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(35)	(0.219)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(35)	(0.219)	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、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(9)	(0.055)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	1	0.008	(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)	(0.007)	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
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	1	0.006	(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)	(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
(そ の 他)	(0)	(0.000)	その他は、金銭信託支払手数料
合 計	81	0.508	
期中の平均基準価額は、15,958円です。			

（注）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）各金額において基準価額は円未満切捨て、その他は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

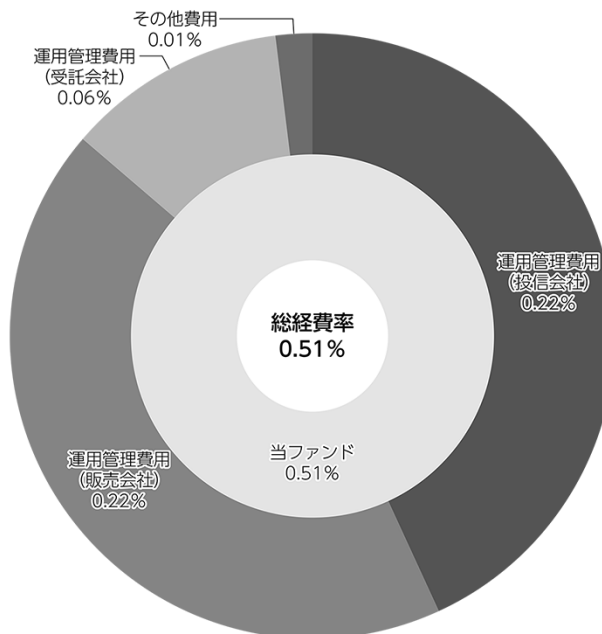
（注）売買委託手数料およびその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

（注）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、売買委託手数料およ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0.51%です。



（注）当ファンドの費用は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、売買委託手数料およ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）当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

（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

(2023年11月28日～2024年11月26日)

公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 7,006	千円 —

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) 単位未満は切捨て。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	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 2,450	千円 5,900	千口 3,324	千円 8,700

(注) 単位未満は切捨て。

○株式売買比率

(2023年11月28日～2024年11月26日)

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・インデックス マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	274,435千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,825,473千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.15

(注) (b)は各月末現在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

(2023年11月28日～2024年11月26日)

利害関係人との取引状況

<ミリオン（従業員積立投資プラン）債券ミックスポートフォリオ>

該当事項はございません。

<ミリオン・インデックス マザーファンド>

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	$\frac{D}{C}$
	百万円 110	百万円 10	% 9.1	百万円 164	百万円 9	% 5.5
株式						

平均保有割合 4.2%

※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。

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)	10千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.565千円
(B) / (A)	5.7%

(注) 売買委託手数料総額は、当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、当ファンドに対応するものです。

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、当ファンドに係る利害関係人とは株式会社SBI証券です。

〇組入資産の明細

(2024年11月26日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちB B格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	千円 49,000	千円 48,129	% 35.8	% —	% —	% 30.6	% 5.2
合 計	49,000	48,129	35.8	—	—	30.6	5.2

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	当 期			末	
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
国債証券	%	千円	千円		
第339回利付国債（10年）	0.4	7,000	7,005	2025/6/20	
第352回利付国債（10年）	0.1	42,000	41,124	2028/9/20	
合 計		49,000	48,129		

(注) 額面・評価額の単位未満は切捨て。

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	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	千口	千円
	30,588	29,714	79,873

(注) 口数・評価額の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2024年11月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円	%
	48,129	35.7
ミリオン・インデックス マザーファンド	79,873	59.3
コール・ローン等、その他	6,707	5.0
投資信託財産総額	134,709	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2024年11月26日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	134,709,076
コール・ローン等	6,686,175
公社債(評価額)	48,129,852
ミリオン・インデックス マザーファンド(評価額)	79,873,253
未収利息	11,052
前払費用	8,744
(B) 負債	431,679
未払収益分配金	41,467
未払信託報酬	386,578
その他未払費用	3,634
(C) 純資産総額(A－B)	134,277,397
元本	82,934,473
次期繰越損益金	51,342,924
(D) 受益権総口数	82,934,473口
1万口当たり基準価額(C／D)	16,191円

(注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、1.6191円です。
(注) 当ファンドの期首元本額は82,515,175円、期中追加設定元本額は1,596,386円、期中一部解約元本額は1,177,088円です。

○損益の状況（2023年11月28日～2024年11月26日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	53,486
受取利息	53,940
支払利息	△ 454
(B) 有価証券売買損益	12,442,585
売買益	13,023,235
売買損	△ 580,650
(C) 信託報酬等	△ 822,507
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	11,673,564
(E) 前期繰越損益金	41,087,557
(F) 追加信託差損益金	△ 1,376,730
(配当等相当額)	(24,865,447)
(売買損益相当額)	(△26,242,177)
(G) 計(D＋E＋F)	51,384,391
(H) 収益分配金	△ 41,467
次期繰越損益金(G＋H)	51,342,924
追加信託差損益金	△ 1,376,730
(配当等相当額)	(24,865,447)
(売買損益相当額)	(△26,242,177)
分配準備積立金	52,719,654

(注) 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) 損益の状況の中で(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) 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、追加設定した価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
(注) 収益分配金

決算期	第37期
(a) 配当等収益(費用控除後)	49,949円
(b) 有価証券等損益額(費用控除後、繰越欠損金補填後)	11,623,615円
(c) 信託約款に規定する収益調整金	24,865,447円
(d) 信託約款に規定する分配準備積立金	41,087,557円
分配対象収益(a＋b＋c＋d)	77,626,568円
分配対象収益(1万口当たり)	9,359円
分配金額	41,467円
分配金額(1万口当たり)	5円

用語解説

○資産、負債、元本及び基準価額の状況は、期末における資産、負債、元本及び基準価額の計算過程を表しています。主な項目の説明は次の通りです。

項 目	説 明
資産	ファンドが保有する財産の合計です。
コール・ローン等	金融機関向けの安全性の高い短期貸付運用などの残高です。
各種有価証券等(評価額)	組入れた株式・債券・ファンドなどの評価金額です。
未収入金	入金が予定されている有価証券の売却代金などです。
未収配当金	入金が予定されている株式の配当金等です。
未収利息	入金が予定されているコール・ローン等の利息や債券の利息の合計です。
負債	支払いが予定されている金額の合計です。
未払収益分配金	期末時点で支払いが予定されている収益分配金です。
未払解約金	支払いが予定されている解約金です。
未払信託報酬	支払いが予定されている信託報酬の額です。
その他未払費用	支払いが予定されている監査費用、その他の費用です。
純資産総額(資産－負債)	ファンドが保有する財産の合計から支払いが予定されている金額の合計を差し引いたものです。
元本	ファンド全体の元本残高です。
次期繰越損益金	純資産総額と元本の差額(翌期に繰り越す損益金の合計額)です。
受益権総口数	受益者が保有する受益権口数の合計です。
1(万)口当たり基準価額	1(万)口当たりのファンドの時価です。

用語解説

○損益の状況は、期中にファンドがどのような収益や損失を計上したかを表しています。主な項目の説明は次の通りです。

項 目	説 明
配当等収益	ファンドが受取った配当金・利息等の合計です。
受取配当金	保有する株式等の配当金等です。
受取利息	債券、コール・ローン等の利息等です。
有価証券売買損益	有価証券の売買損益と期末の評価損益の合計額です。
売買益	売買益と期末評価益の合計です。
売買損	売買損と期末評価損の合計です。
信託報酬等	信託報酬のほか保管費用、監査費用、その他の費用と、それらに掛かる消費税等相当額です。
当期損益金	当期における収支合計です。
前期繰越損益金	前期分の分配準備積立金と繰越損益金の合計額から当期中の解約に対する持分を控除した金額です。
追加信託差損益金	受益者がファンドに払い込んだ金額と元本との差額です。
(配当等相当額)	配当等に相当する額です。
(売買損益相当額)	売買損益に相当する額です。
計	収益分配前の期中の収支の総合計です。
収益分配金	期中の分配可能額から受益者に支払われる分配金です。
次期繰越損益金	翌期に繰り越す損益金の合計です。
追加信託差損益金	翌期に繰り越す追加信託差損益金です。
(配当等相当額)	配当等に相当する額です。
(売買損益相当額)	売買損益に相当する額です。
分配準備積立金	翌期に繰り越す分配準備積立金の額です。
繰越損益金	翌期に繰り越す損益金の額です。

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税引前）	5円
-----------------	----

（注）分配金は、税金を差し引いた後全額再投資いたしました。

＜お知らせ＞

- ・取得申込の受付の中止および取消し、ならびに一部解約において、実行の請求の受付の中止および取消しの記載について所要の整備を行いました。（実施日：2024年2月27日）
- ・信託報酬率を「年10,000分の60の率」から「年10,000分の45の率」に変更しました。（実施日：2024年8月27日）

＜当ファンドの参考指数について＞

「日経平均株価（日経平均）」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」自体及び「日経平均」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。

「日経」及び「日経平均」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属します。

本件投資信託は、投資信託委託業者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、その運用及び本件受益権の取引に関して、一切の責任を負いません。

株式会社日本経済新聞社は、「日経平均」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。

株式会社日本経済新聞社は、「日経平均」の構成銘柄、計算方法、その他、「日経平均」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。

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

「日経」及び「日経平均トータルリターン・インデックス」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属します。

本件投資信託は、投資信託委託業者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、その運用及び本件受益権の取引に関して、一切の責任を負いません。

株式会社日本経済新聞社は、「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、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。

株式会社日本経済新聞社は、「日経平均トータルリターン・インデックス」の構成銘柄、計算方法、その他、「日経平均トータルリターン・インデックス」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。

※当資料中においては、「日経平均株価」と「日経平均株価（225種）」を同一の意味で使用しております。

ミリオン・インデックス マザーファンド
第37期 運用状況のご報告
決算日：2024年11月26日

当ファンドの仕組みは次の通りです。

運 用 方 針	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）に採用された銘柄を主要投資対象とし、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・インデックスに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	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）に採用された銘柄を主要投資対象とします。
投 資 制 限	株式への投資には、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（225種）		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
	期 騰 落	中 率	(ベンチマーク) 期 騰 落	中 率	(ベンチマーク) 期 騰 落	中 率			
	円	%	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
33期(2020年11月26日)	1,714	15.7	26,537.31	13.5	—	—	85.4	13.9	1,723
34期(2021年11月26日)	1,885	10.0	28,751.62	8.3	—	—	95.8	3.5	1,628
35期(2022年11月28日)	1,874	△ 0.6	28,162.83	△ 2.0	—	—	94.6	3.7	1,537
36期(2023年11月27日)	2,277	21.5	33,447.67	18.8	—	—	95.3	3.9	1,708
37期(2024年11月26日)	2,688	18.1	—	—	68,551.34	—	96.9	2.0	1,898

(注) 基準価額は1千口当たり。

(注) 2024年2月27日に日経平均株価（225種）から日経平均トータルリターン・インデックスにベンチマークを変更いたしました。

(注) 株式先物比率＝買建比率－売建比率。

○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（２２５種）		日 経 平 均 ト ー タ ル リターン・インデックス		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期 首) 2023年11月27日	円 2,277	% —	円 33,447.67	% —	ポイント —	% —	% 95.3	% 3.9
11月末	2,281	0.2	33,486.89	0.1	—	—	95.3	3.9
12月末	2,286	0.4	33,464.17	0.0	—	—	95.1	3.9
2024年1月末	2,485	9.1	36,286.71	8.5	—	—	97.3	2.0
2月末	2,709	19.0	—	—	68,747.00	—	97.2	2.0
3月末	2,803	23.1	—	—	71,346.41	—	97.0	2.0
4月末	2,632	15.6	—	—	67,877.75	—	97.4	2.0
5月末	2,636	15.8	—	—	68,023.40	—	97.1	2.0
6月末	2,731	19.9	—	—	70,056.40	—	97.4	2.0
7月末	2,691	18.2	—	—	69,208.61	—	97.3	2.0
8月末	2,666	17.1	—	—	68,452.55	—	97.3	2.0
9月末	2,632	15.6	—	—	67,604.81	—	96.5	2.0
10月末	2,727	19.8	—	—	69,678.38	—	96.7	2.0
(期 末) 2024年11月26日	2,688	18.1	—	—	68,551.34	—	96.9	2.0

(注) 騰落率は期首比。

運用経過

期中の基準価額等の推移

(2023年11月28日～2024年11月26日)



(注) ベンチマークは、日経平均株価 (225種) および日経平均トータルリターン・インデックスです。

(注) ベンチマークは、期首 (2023年11月27日) の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

(注) 2024年2月27日に日経平均株価 (225種) から日経平均トータルリターン・インデックスにベンチマークを変更いたしました。そのため、日経平均株価 (225種) の推移は2024年2月26日までを記載、日経平均トータルリターン・インデックスの推移は見やすさの観点から期首 (2023年11月27日) より記載しております。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドにおけるベンチマーク (日経平均トータルリターン・インデックス) に対する主なプラス要因およびマイナス要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・特にありません。

(主なマイナス要因)

- ・投資資金の増減および日経平均株価 (225種) 採用銘柄入れ替え時などに発生する株式や日経平均株価先物の売買コストなどがマイナス要因となりました。

投資環境

(2023年11月28日～2024年11月26日)

国内株式市場は上昇しました。2024年3月にかけては、堅調な企業業績や増配、自己株式取得といった株主還元拡充への期待を背景に上昇しました。また、資本コストを意識した経営への変化を評価する海外投資家からの資金流入が継続したことも株価押し上げ要因となりました。その後は、為替市場での円安進行の一方で、米国の早期利下げ観測が後退したことや中東情勢の悪化などもあり一進一退の動きとなりました。8月以降は、低調な経済指標を受けて米国の景気悪化懸念が強まったことや、日銀が7月末に追加利上げを行い、今後の利上げに対して積極的な姿勢を示したことで円高や株安が一時急速に進行するなど、景気や企業業績に対する不透明感が強まり上下に振れの大きい動きとなりました。しかし、自民党総裁選挙や衆議院選挙、米大統領選挙などの重要な政治イベントを通過すると、株式市場は落ち着きを取り戻して期末を迎えました。

当ファンドのポートフォリオ

(2023年11月28日～2024年11月26日)

当ファンドの先物を含む株式組入比率は、期を通じて100%に近い高水準を維持しました。

当期につきましては、運用の基本方針に則って日経平均トータルリターン・インデックスに連動する投資成果を目指して運用を行いました。具体的には、日経平均株価（225種）採用銘柄から財務リスクなどを考慮したポートフォリオを構築し、運用を行いました。また資金動向に柔軟に対応し、かつ株式組入比率を高水準に維持するため、日経平均株価先物を一部組み入れ、運用しました。追加設定・一部解約などの投資資金の増減に対しては、日経平均株価先物および組入銘柄の調整売買で対応しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2023年11月28日～2024年11月26日)

当ファンドのベンチマークは、2024年2月26日までは日経平均株価（225種）でしたが、2024年2月27日以降は、日経平均トータルリターン・インデックスに変更いたしました。このため、当期中にベンチマークが変更となったことからファンドとの比較ができないため、騰落率の掲載は行っておりません。

今後の運用方針

運用の基本方針に則り、先物を含む株式組入比率を高位に保ち、日経平均トータルリターン・インデックスと連動する投資成果を目指して運用してまいります。

○ 1千口当たりの費用明細

(2023年11月28日～2024年11月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
	円	%	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.013	(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
(株 式)	(0)	(0.012)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(b) そ の 他 費 用	0	0.000	(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)	(0.000)	その他は、金銭信託支払手数料
合 計	0	0.013	
期中の平均基準価額は、2,606円です。			

- (注) 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) 各金額において基準価額は円未満切捨て、その他は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
- (注) 各比率は1千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

(2023年11月28日～2024年11月26日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	上場	千株	千円	千株	千円
内		17	110,072	36	164,363
		(117)	()		

- (注) 金額は受渡代金。
- (注) 単位未満は切捨て。
- (注) ()内は株式分割、予約権行使、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。

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 180	百万円 217	百万円 －	百万円 －

(注) 単位未満は切捨て。

○株式売買比率

(2023年11月28日～2024年11月26日)

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	274, 435千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1, 825, 473千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0. 15

(注) (b) は各月末現在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

(2023年11月28日～2024年11月26日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	
		うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
株式	百万円 110	百万円 10	% 9. 1	百万円 164	百万円 9	% 5. 5

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)	237千円
うち利害関係人への支払額 (B)	13千円
(B) / (A)	5. 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、当ファンドに係る利害関係人とは株式会社 S B I 証券です。

○組入資産の明細

(2024年11月26日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.0%)			
ニッスイ	1	1	920
鉱業 (0.0%)			
I N P E X	0.4	0.4	790
建設業 (1.0%)			
コムシスホールディングス	1	1	3,296
大成建設	0.2	0.2	1,329
大林組	1	1	2,125
清水建設	1	1	1,171
長谷工コーポレーション	0.2	0.2	396
鹿島建設	0.5	0.5	1,349
大和ハウス工業	1	1	4,661
積水ハウス	1	1	3,586
日揮ホールディングス	1	1	1,325
食料品 (1.9%)			
日清製粉グループ本社	1	1	1,819
明治ホールディングス	0.4	0.4	1,279
日本ハム	0.5	0.5	2,555
サッポロホールディングス	0.2	0.2	1,727
アサヒグループホールディングス	1	3	4,818
キリンホールディングス	1	1	2,087
宝ホールディングス	1	—	—
キッコーマン	2	5	8,397
味の素	1	1	6,206
ニチレイ	0.5	0.5	2,057
日本たばこ産業	1	1	4,253
繊維製品 (0.1%)			
帝人	0.2	0.2	271
東レ	1	1	962
パルプ・紙 (0.0%)			
王子ホールディングス	1	1	555
日本製紙	0.1	—	—
化学 (6.7%)			
クラレ	1	1	2,099

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
旭化成	1	1	1,097
レゾナック・ホールディングス	0.1	0.1	399
住友化学	1	1	377
日産化学	1	1	5,477
東ソー	0.5	0.5	1,056
トクヤマ	0.2	0.2	541
デンカ	0.2	0.2	427
信越化学工業	10	10	56,600
三井化学	0.2	0.2	704
三菱ケミカルグループ	0.5	0.5	421
UBE	0.1	0.1	246
花王	1	1	6,562
D I C	0.1	—	—
富士フイルムホールディングス	2	6	19,848
資生堂	1	1	2,835
日東電工	2	10	24,085
医薬品 (5.5%)			
協和キリン	1	1	2,469
武田薬品工業	1	1	4,132
アステラス製薬	10	5	7,860
住友ファーマ	1	1	601
塩野義製薬	1	3	6,432
中外製薬	6	6	38,250
エーザイ	2	1	4,619
第一三共	6	6	27,300
大塚ホールディングス	1	1	8,613
石油・石炭製品 (0.2%)			
出光興産	0.4	2	2,008
E N E O Sホールディングス	1	1	792
ゴム製品 (0.4%)			
横浜ゴム	0.5	0.5	1,547
ブリヂストン	1	1	5,372
ガラス・土石製品 (0.4%)			
A G C	0.2	0.2	930

ミリオン・インデックス マザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本電気硝子	0.3	0.3	1,027
住友大阪セメント	0.1	—	—
太平洋セメント	0.1	0.1	373
東海カーボン	1	1	921
TOTO	0.5	0.5	2,028
日本碍子	1	1	2,002
鉄鋼 (0.0%)			
日本製鉄	0.1	0.1	305
神戸製鋼所	0.1	0.1	158
JFEホールディングス	0.1	0.1	171
大太平洋金属	0.1	—	—
非鉄金属 (0.7%)			
三井金属鉱業	0.1	0.1	475
三菱マテリアル	0.1	0.1	242
住友金属鉱山	0.5	0.5	1,882
DOWAホールディングス	0.2	0.2	899
古河電気工業	0.1	0.1	613
住友電気工業	1	1	2,965
フジクラ	1	1	5,259
金属製品 (0.0%)			
SUMCO	0.1	0.1	123
機械 (4.0%)			
日本製鋼所	0.2	0.2	1,284
オークマ	0.2	0.4	1,256
アマダ	1	1	1,471
ディスコ	—	0.2	8,278
SMC	0.2	0.1	6,707
小松製作所	1	1	4,182
住友重機械工業	0.2	0.2	639
日立建機	1	1	3,407
クボタ	1	1	1,923
荏原製作所	0.2	1	2,199
ダイキン工業	2	2	37,010
日本精工	1	1	671
NTN	1	1	245
ジェイテクト	1	1	1,078
カナデビア	0.2	0.2	191
三菱重工業	0.1	1	2,259
IHI	0.1	0.1	790

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
電気機器 (28.1%)			
コニカミノルタ	1	1	693
ミネベアミツミ	1	1	2,441
日立製作所	0.2	1	3,712
三菱電機	1	1	2,559
富士電機	0.2	0.2	1,687
安川電機	1	1	4,121
ソシオネクスト	—	1	2,339
ニデック	0.8	1.6	4,510
オムロン	1	1	4,964
ジーエス・ユアサ コーポレーション	0.2	0.2	553
日本電気	0.1	0.1	1,246
富士通	0.1	1	2,744
ルネサスエレクトロニクス	1	1	2,000
セイコーエプソン	2	2	5,469
パナソニック ホールディングス	1	1	1,518
シャープ	1	1	1,009
ソニーグループ	2	10	29,830
TDK	6	30	55,455
アルプスアルパイン	1	1	1,552
横河電機	1	1	3,447
アドバンテスト	16	16	141,344
キーエンス	0.1	0.1	6,558
レーザーテック	0.8	0.8	13,364
カシオ計算機	1	1	1,076
ファナック	10	10	41,780
京セラ	4	16	23,656
太陽誘電	1	1	2,149
村田製作所	2.4	2.4	6,061
SCREENホールディングス	0.4	0.4	3,556
キヤノン	1.5	1.5	7,470
リコー	1	1	1,724
東京エレクトロン	6	6	135,900
輸送用機器 (3.7%)			
デンソー	8	4	8,952
川崎重工業	0.1	0.1	588
日産自動車	1	1	392
いすゞ自動車	0.5	0.5	1,036
トヨタ自動車	10	10	26,675

ミリオン・インデックス マザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日野自動車	1	1	408
三菱自動車工業	0.1	0.1	42
マツダ	0.2	0.2	199
本田技研工業	12	12	15,996
スズキ	1	4	6,524
S U B A R U	1	1	2,501
ヤマハ発動機	1	3	4,029
精密機器 (4.4%)			
テルモ	8	16	49,536
ニコン	1	1	1,852
オリンパス	8	8	19,600
H O Y A	1	0.5	9,785
シチズン時計	1	1	898
その他製品 (1.4%)			
バンダイナムコホールディングス	6	3	9,831
T O P P A Nホールディングス	0.5	0.5	1,990
大日本印刷	0.5	1	2,304
ヤマハ	1	3	3,300
任天堂	1	1	8,309
電気・ガス業 (0.1%)			
東京電力ホールディングス	0.1	0.1	54
中部電力	0.1	0.1	159
関西電力	0.1	0.1	183
東京瓦斯	0.2	0.2	877
大阪瓦斯	0.2	0.2	646
陸運業 (0.6%)			
東武鉄道	0.2	0.2	521
東急	0.5	0.5	916
小田急電鉄	0.5	0.5	808
京王電鉄	0.2	0.2	813
京成電鉄	0.5	0.5	2,209
東日本旅客鉄道	0.1	0.3	849
西日本旅客鉄道	0.1	0.2	561
東海旅客鉄道	0.5	0.5	1,567
ヤマトホールディングス	1	1	1,755
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	0.1	0.1	759
海運業 (0.3%)			
日本郵船	0.3	0.3	1,461
商船三井	0.3	0.3	1,602

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
川崎汽船	0.3	0.9	1,849
空運業 (0.1%)			
日本航空	1	1	2,445
ANAホールディングス	0.1	0.1	285
倉庫・運輸関連業 (0.1%)			
三菱倉庫	0.5	2.5	2,736
情報・通信業 (13.4%)			
ネクソン	2	2	4,226
野村総合研究所	—	1	4,427
メルカリ	1	1	1,911
L I N Eヤフー	0.4	0.4	164
トレンドマイクロ	1	1	8,308
日本電信電話	10	10	1,543
K D D I	12	12	59,112
ソフトバンク	1	10	1,914
東宝	0.1	0.1	620
N T Tデータグループ	10	10	28,695
コナミグループ	2	2	29,320
ソフトバンクグループ	12	12	106,128
卸売業 (1.9%)			
双日	0.1	0.1	309
伊藤忠商事	1	1	7,450
丸紅	1	1	2,319
豊田通商	2	3	7,866
三井物産	1	2	6,436
住友商事	1	1	3,224
三菱商事	1	3	7,698
小売業 (17.0%)			
J．フロント リテイリング	0.5	0.5	874
Z O Z O	—	1	4,844
三越伊勢丹ホールディングス	1	1	2,180
セブン&アイ・ホールディングス	1	3	7,659
良品計画	—	1	3,013
高島屋	0.5	1	1,205
丸井グループ	1	1	2,427
イオン	1	1	3,557
ニトリホールディングス	0.3	0.5	9,275
ファーストリテイリング	6	5.4	277,830

ミリオン・インデックス マザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
銀行業 (0.5%)			
しずおかフィナンシャルグループ	1	1	1,328
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1	1	890
あおぞら銀行	0.1	0.1	241
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1	1	1,794
りそなホールディングス	0.1	0.1	123
三井住友トラストグループ	0.1	0.2	728
三井住友フィナンシャルグループ	0.1	0.3	1,079
千葉銀行	1	1	1,198
ふくおかフィナンシャルグループ	0.2	0.2	827
みずほフィナンシャルグループ	0.1	0.1	375
証券、商品先物取引業 (0.1%)			
大和証券グループ本社	1	1	1,008
野村ホールディングス	1	1	922
保険業 (0.8%)			
SOMPOホールディングス	0.2	0.6	2,337
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	0.3	0.9	3,089
第一生命ホールディングス	0.1	0.1	383
東京海上ホールディングス	1.5	1.5	8,527
T&Dホールディングス	0.2	0.2	507
その他金融業 (0.6%)			
クレディセゾン	1	1	3,677

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
オリックス	1	1	3,313
日本取引所グループ	1	2	3,565
不動産業 (0.7%)			
東急不動産ホールディングス	1	1	989
三井不動産	1	3	3,777
三菱地所	1	1	2,126
東京建物	0.5	0.5	1,335
住友不動産	1	1	4,484
サービス業 (5.3%)			
エムスリー	2.4	2.4	3,517
ディー・エヌ・エー	0.3	0.3	747
電通グループ	1	1	3,787
オリエンタルランド	1	1	3,435
サイバーエージェント	0.8	0.8	830
楽天グループ	1	1	862
リクルートホールディングス	6	6	61,080
日本郵政	1	1	1,460
セコム	2	4	20,852
合 計	株 数 ・ 金 額	329	427
	銘柄数<比率>	225	225

(注) 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) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。
(注) 評価額の単位未満は切捨て。

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	株式先物取引	日経225	百万円 百万円
			38 ー

(注) 単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2024年11月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	1,838,735	96.9
コール・ローン等、その他	59,269	3.1
投資信託財産総額	1,898,004	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年11月26日現在)

○損益の状況 (2023年11月28日～2024年11月26日)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,898,004,881
コール・ローン等	46,838,144
株式(評価額)	1,838,735,730
未収入金	2,979,120
未収配当金	10,339,420
未収利息	230
差入委託証拠金	△ 887,763
(B) 負債	0
(C) 純資産総額(A－B)	1,898,004,881
元本	706,103,735
次期繰越損益金	1,191,901,146
(D) 受益権総口数	706,103,735口
1千口当たり基準価額(C／D)	2,688円

(注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、2,6880円です。

(注) 当ファンドの期首元本額は750,454,194円、期中追加設定元本額は2,450,489円、期中一部解約元本額は46,800,948円です。

(注) 当親ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は、以下の通りです。

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 676,388,983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 29,714,752円

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	30,686,565
受取配当金	30,652,394
受取利息	36,023
その他収益金	1,533
支払利息	△ 3,385
(B) 有価証券売買損益	264,863,664
売買益	354,662,641
売買損	△ 89,798,977
(C) 先物取引等取引損益	8,131,320
取引益	12,371,600
取引損	△ 4,240,280
(D) その他費用等	△ 3,077
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	303,678,472
(F) 前期繰越損益金	958,122,215
(G) 追加信託差損益金	3,449,511
(H) 解約差損益金	△ 73,349,052
(I) 計(E＋F＋G＋H)	1,191,901,146
次期繰越損益金(I)	1,191,901,146

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定した価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 損益の状況の中で(H)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。

＜お知らせ＞

ベンチマークを「日経平均株価」から「日経平均トータルリターン・インデックス」に変更しました。（実施日：2024年2月27日）

＜当ファンドのベンチマークについて＞

「日経平均株価（日経平均）」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」自体及び「日経平均」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。

「日経」及び「日経平均」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属します。

本件投資信託は、投資信託委託業者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、その運用及び本件受益権の取引に関して、一切の責任を負いません。

株式会社日本経済新聞社は、「日経平均」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。

株式会社日本経済新聞社は、「日経平均」の構成銘柄、計算方法、その他、「日経平均」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。

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

「日経」及び「日経平均トータルリターン・インデックス」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属します。

本件投資信託は、投資信託委託業者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、その運用及び本件受益権の取引に関して、一切の責任を負いません。

株式会社日本経済新聞社は、「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、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。

株式会社日本経済新聞社は、「日経平均トータルリターン・インデックス」の構成銘柄、計算方法、その他、「日経平均トータルリターン・インデックス」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。

※当資料中においては、「日経平均株価」と「日経平均株価（225種）」を同一の意味で使用しております。