

## 【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成26年9月25日提出
【発行者名】	新光投信株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 後藤 修一
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目17番10号
【事務連絡者氏名】	上中 徹
【電話番号】	03-6860-6440
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	インデックスポートフォリオ
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	継続募集額(平成26年2月8日から平成27年2月6日まで) 3兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成26年 2月 7日付をもって提出した有価証券届出書（平成26年8月7日付をもって提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済み。以下「原届出書」といいます。）の記載事項に訂正すべき事項がありますので、これを訂正するとともに、併せて原届出書添付書類の訂正を行うため提出するものです。

## 2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部\_\_\_\_\_は訂正部分を示し、<追加後>に記載している内容は原届出書に追加され、<更新後>に記載している内容は原届出書が更新されます。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

<訂正前>

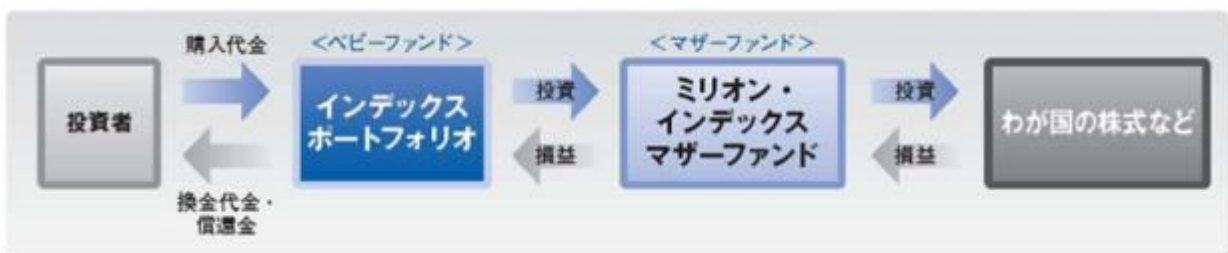
##### a．ファンドの目的及び基本的性格

（略）

### ファンドの仕組み

当ファンドの運用は「ファミリーファンド方式」で行います。

「ファミリーファンド方式」とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をベビーファンド（当ファンド）としてとりまとめ、その資金の全部または一部をマザーファンドに投資することにより、実質的な運用をマザーファンドで行う仕組みです。マザーファンドの損益はベビーファンドに反映されます。



##### b．ファンドの特色

- 1．主としてミリオン・インデックスマザーファンド<sup>\*</sup>（以下「マザーファンド」という場合があります。）に投資し、「日経平均株価」の動きにできるだけ連動する投資成果を目指します。

当ファンドの運用は「ファミリーファンド方式」で行います。

### マザーファンドの運用方針

わが国の取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄を投資対象とし、日経平均株価の動きにできるだけ連動する成果を目指します。

日経平均株価をモデルとして運用します。

投資対象銘柄のうち、原則として100銘柄以上に分散投資します。

株式の価格変動リスクを回避するため、大阪取引所における株式の先物取引を行うことがあります。

- 2．ミリオンには、2つの特色あるポートフォリオがあります。

2つのポートフォリオのうち、どちらか一方または両方を自由に選択できます。

ポートフォリオ	運用対象	組入比率(程度)	特 色
インデックス ポートフォリオ (当ファンド)	ミリオン・インデックス マザーファンド*	100%	日経平均株価の動きに連動した投資成果を目指します。
ボンドミックス ポートフォリオ	ミリオン・インデックス マザーファンド*	50%	日経平均株価の動きに連動した投資成果の獲得とともに安定性の確保に努めます。
	公社債	50%	

上記組入比率については、株式・債券市況その他の要因などにより変更になることがあります。

株式など値動きのある証券に投資しますので、市況などにより運用実績は変動します。

#### (注)

「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。株式会社日本経済新聞社は同社の100%子会社である株式会社日本経済新聞デジタルメディアに「日経平均株価」の運営を委託しています。

「日経」および「日経平均株価」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ています。

当ファンドは、投資信託委託会社など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および株式会社日本経済新聞デジタルメディアは、その運用および当ファンドの受益権の取引に関して、一切責任を負いません。

株式会社日本経済新聞社および株式会社日本経済新聞デジタルメディアは、「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、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。

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

#### \*約款変更の予定について

当ファンドにおいて、下記の約款変更を予定しております。

- ・当ファンドの主要投資対象である「ミリオン・インデックスマザーファンド受益証券」を「インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド受益証券」に変更いたします。

平成26年8月8日時点の当ファンドの受益者のうち、この約款変更に関する異議を申し出た受益者の受益権口数が同時点の受益権総口数の過半数に満たない場合は、平成26年9月24日に約款変更の届出を行い、平成26年10月21日より適用します。なお、この約款変更に基づく投資対象マザーファンドの入替処理において、マザーファンドを通じた株式への投資が無くなり、株価変動が当ファンドの投資成果に反映されない期間が一時的に発生します。

平成26年8月8日時点の当ファンドの受益者のうち、この約款変更に関する異議を申し出た受益者の受益権口数が同時点の受益権総口数の過半数となった場合は、この約款変更は実施されません。この場合、約款変更を実施しない旨およびその理由について公告を行い、かつこれらの事項を記載した書面を受益者に交付します。

## 主な投資制限

投資信託証券への投資割合	マザーファンドへの投資割合には制限を設けません。
外貨建資産への投資割合	外貨建資産への投資は行いません。

(略)

<訂正後>

a. ファンドの目的及び基本的性格

(略)

## ファンドの仕組み

当ファンドの運用は「ファミリーファンド方式」で行います。

「ファミリーファンド方式」とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をベビーファンド（当ファンド）としてとりまとめ、その資金の全部または一部をマザーファンドに投資することにより、実質的な運用をマザーファンドで行う仕組みです。マザーファンドの損益はベビーファンドに反映されます。



\*平成26年10月21日以降はインデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンドとなります。

なお、この約款変更に基づく投資対象マザーファンドの入替処理において、マザーファンドを通じた株式への投資が無くなり、株価変動が当ファンドの投資成果に反映されない期間が一時的に発生します。

### b. ファンドの特色

\*当ファンドの主要投資対象である「ミリオン・インデックスマザーファンド受益証券」を「インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド受益証券」に変更する約款変更を行います。約款変更の届出は、平成26年9月24日に行い、平成26年10月21日より適用します。

1. 主としてミリオン・インデックスマザーファンド（平成26年10月21日以降はインデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド）（以下「マザーファンド」という場合があります。）に投資し、「日経平均株価」の動きにできるだけ連動する投資成果を目指します。

当ファンドの運用は「ファミリーファンド方式」で行います。

### マザーファンドの運用方針

#### <平成26年10月20日まで> ミリオン・インデックスマザーファンド

わが国の取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄を投資対象とし、日経平均株価の動きにできるだけ連動する成果を目指します。

日経平均株価をモデルとして運用します。

投資対象銘柄のうち、原則として100銘柄以上に分散投資します。

株式の価格変動リスクを回避するため、大阪取引所における株式の先物取引を行うことがあります。

#### <平成26年10月21日以降> インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド

東京証券取引所第一部に上場されている株式のうち、日経平均株価に採用された銘柄の中から200銘柄以上に、原則として等株数投資を行い、日経平均株価に連動する投資成果を目指した運用を行います。

2. ミリオンには、2つの特色あるポートフォリオがあります。

2つのポートフォリオのうち、どちらか一方または両方を自由に選択できます。

ポートフォリオ	運用対象	組入比率(程度)	特 色
インデックス ポートフォリオ (当ファンド)	ミリオン・インデックス マザーファンド*	100%	日経平均株価の動きに連動した投資成果を目指します。
ボンドミックス ポートフォリオ	ミリオン・インデックス マザーファンド*	50%	日経平均株価の動きに連動した投資成果の獲得とともに安定性の確保に努めます。
	公社債	50%	

上記組入比率については、株式・債券市況その他の要因などにより変更になることがあります。

株式など値動きのある証券に投資しますので、市況などにより運用実績は変動します。

\*平成26年10月21日以降はインデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンドとなります。

(注)

「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。株式会社日本経済新聞社は同社の100%子会社である株式会社日本経済新聞デジタルメディアに「日経平均株価」の運営を委託しています。

「日経」および「日経平均株価」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ています。

当ファンドは、投資信託委託会社など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および株式会社日本経済新聞デジタルメディアは、その運用および当ファンドの受益権の取引に関して、一切責任を負いません。

株式会社日本経済新聞社および株式会社日本経済新聞デジタルメディアは、「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、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。

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

## 主な投資制限

投資信託証券への投資割合	マザーファンドへの投資割合には制限を設けません。
外貨建資産への投資割合	外貨建資産への投資は行いません。

(略)

### (2)【ファンドの沿革】

<訂正前>

昭和62年11月27日	投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始
平成12年11月15日	関東財務局長に対して有価証券届出書提出

<訂正後>

昭和62年11月27日	投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始
-------------	-----------------------

平成12年11月15日  
平成26年9月24日

関東財務局長に対して有価証券届出書提出  
主要投資対象である、「ミリオン・インデックスマザー  
ファンド受益証券」を「インデックス マネジメント  
ファンド 225 マザーファンド受益証券」に変更する  
約款変更の届出

(3) 【ファンドの仕組み】

<訂正前>

b. 委託会社の概況

(イ) 資本金の額（平成26年5月末現在）

資本金の額	45億2,430万円
会社が発行する株式総数	3,000,000株
発行済株式総数	1,823,250株

(ロ) 委託会社の沿革

昭和36年6月	大井証券投資信託委託株式会社設立・免許取得
昭和44年10月	新和光投信委託株式会社に社名変更
昭和61年11月	有価証券等に関する投資助言・情報提供業務の認可
平成8年8月	投資顧問業者の登録
平成8年12月	投資一任契約にかかる業務の認可
平成9年11月	投資信託の直接販売業務の認可
平成10年12月	証券投資信託法の改正に伴う投資信託の証券投資信託委託業のみなし認可
平成12年4月	太陽投信委託株式会社と合併し、新光投信株式会社に社名変更

(ハ) 大株主の状況

（平成26年5月末現在）

株主名	住所	持株数	持株比率
みずほ証券株式会社	東京都千代田区大手町1-5-1	1,396,362株	76.58%
株式会社みずほ銀行	東京都千代田区大手町1-5-5	182,115	9.98
株式会社みずほ証券リサーチ & コンサルティング	東京都中央区日本橋1-17-10	137,200	7.52

<訂正後>

b. 委託会社の概況

(イ) 資本金の額（平成26年6月末現在）

資本金の額	45億2,430万円
会社が発行する株式総数	3,000,000株
発行済株式総数	1,823,250株

(ロ) 委託会社の沿革

昭和36年6月	大井証券投資信託委託株式会社設立・免許取得
昭和44年10月	新和光投信委託株式会社に社名変更
昭和61年11月	有価証券等に関する投資助言・情報提供業務の認可

平成 8 年 8 月 投資顧問業者の登録  
 平成 8 年12月 投資一任契約にかかる業務の認可  
 平成 9 年11月 投資信託の直接販売業務の認可  
 平成10年12月 証券投資信託法の改正に伴う投資信託の証券投資信託委託業のみ  
 なし認可  
 平成12年 4 月 太陽投信委託株式会社と合併し、新光投信株式会社に社名変更

(八) 大株主の状況

(平成26年 6 月末現在)

株 主 名	住 所	持 株 数	持株比率
みずほ証券株式会社	東京都千代田区大手町 1 - 5 - 1	1,396,362株	76.58%
株式会社みずほ銀行	東京都千代田区大手町 1 - 5 - 5	182,115	9.98
株式会社みずほ証券リサーチ & コンサルティング	東京都中央区日本橋 1 - 17 - 10	137,200	7.52

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<訂正前>

a. 基本方針

当ファンドは、投資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。

b. 運用の方法

(イ) 主要投資対象

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。）受益証券を主要投資対象とします。

(ロ) 投資態度

マザーファンドに投資し、日経平均株価にできるだけ連動する成果をめざします。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。

(ハ) 主な投資制限

マザーファンドへの投資割合には、制限を設けません。

マザーファンドの運用方針

ミリオン・インデックスマザーファンド

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式市場の動き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す。

2. 運用方法

(1) 投資対象



わが国の取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄を投資対象とします。

## (2) 投資態度

投資成果を日経平均株価の動きにできるだけ連動させるよう、所定のシステムに基づき、上記投資対象銘柄のうち原則として100銘柄以上に、分散投資を行います。

株式の価格変動リスクを回避するため、大阪取引所における株式の先物取引を行うことがあります。

有価証券等の価格変動リスクを回避するため、有価証券先物取引等を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、スワップ取引を行うことができます。

## (3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

## 3. 収益分配方針

運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。

<訂正後>

<平成26年10月20日まで>

### a. 基本方針

当ファンドは、投資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。

### b. 運用の方法

#### (イ) 主要投資対象

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。）受益証券を主要投資対象とします。

#### (ロ) 投資態度

マザーファンドに投資し、日経平均株価にできるだけ連動する成果をめざします。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。

#### (ハ) 主な投資制限

マザーファンドへの投資割合には、制限を設けません。

## マザーファンドの運用方針

### ミリオン・インデックスマザーファンド

#### 1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式市場の動き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す。

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

わが国の取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄を投資対象とします。

##### (2) 投資態度

投資成果を日経平均株価の動きにできるだけ連動させるよう、所定のシステムに基づき、上記投資対象銘柄のうち原則として100銘柄以上に、分散投資を行います。

株式の価格変動リスクを回避するため、大阪取引所における株式の先物取引を行うことがあります。

有価証券等の価格変動リスクを回避するため、有価証券先物取引等を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、スワップ取引を行うことができます。

### (3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

## 3. 収益分配方針

運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。

## <平成26年10月21日以降>

### a. 基本方針

当ファンドは、投資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。

### b. 運用の方法

#### (イ) 主要投資対象

インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。) 受益証券を主要投資対象とします。

#### (ロ) 投資態度

マザーファンドに投資し、日経平均株価にできるだけ連動する成果をめざします。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引と類似の取引(以下「有価証券先物取引等」といいます。)を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことができます。

#### (ハ) 主な投資制限

マザーファンドへの投資割合には、制限を設けません。

## マザーファンドの運用方針

インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド

### 1. 基本方針

この投資信託は、日経平均株価(225種・東証)に連動する投資成果をめざした運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とします。

#### (2) 投資態度

東京証券取引所第一部に上場されている株式のうち、日経平均株価(225種・東証)に採用された銘柄の中から200銘柄以上に、原則として等株数投資を行います。

株式の組入比率は、高位を保ちます。

有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の有価証券指数等先物取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引と類似の取引を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

株式以外の資産への投資は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。ただし、市況動向に急激な変化が生じたときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行いません。

## 3. 収益分配方針

運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。

## (2) 【投資対象】

<訂正前>

### a. 運用の指図範囲

委託者は、信託金を、新光投信株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたミリオン・インデックスマザーファンド（金融システム改革のための関係法律の整備等に関する法律附則第84条により証券投資信託とみなされた信託、以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券のほか次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。有価証券は、本邦通貨表示のものに限ります。）で市場性のあるものに投資することを指図します。ただし、余裕金については、預金、指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）、コール・ローン、手形割引市場において売買される手形、貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものにより運用することの指図ができます。

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する証券で、前号の証券の性質を有するもの
3. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
4. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

### b. 先物

委託者は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、現物オプション取引は預金に限るものとします。

1. 先物取引の売り建ておよびコール・オプションの売り付けの指図は、建玉の合計額がヘッジ対象とする金利商品（以下、「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買い建ておよびプット・オプションの売り付けの指図は、建玉の合計額が、投資信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに余裕金の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買い付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の投資信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

#### c. スワップ

- (イ) 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件をもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額とマザーファンドの投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引想定元本の合計額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記（ハ）において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該スワップ取引の想定元本の総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ヘ) 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受け入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受け入れの指図を行うことができます。

< 訂正後 >

< 平成26年10月20日まで >

#### a. 運用の指図範囲

委託者は、信託金を、新光投信株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたミリオン・インデックスマザーファンド（金融システム改革のための関係法律の整備等に関する法律附則第84条により証券投資信託とみなされた信託、以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券のほか次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。有価証券は、本邦通貨表示のものに限ります。）で市場性のあるものに投資することを指図します。ただし、余裕金については、預金、指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）、コール・ローン、手形割引市場において売買される手形、貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものにより運用す

ることの指図ができます。

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する証券で、前号の証券の性質を有するもの
3. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
4. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

b. 先物

委託者は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、現物オプション取引は預金に限るものとします。

1. 先物取引の売り建ておよびコール・オプションの売り付けの指図は、建玉の合計額がヘッジ対象とする金利商品（以下、「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買い建ておよびプット・オプションの売り付けの指図は、建玉の合計額が、投資信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに余裕金の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買い付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の投資信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

c. スワップ

(イ) 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件をもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

(ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

(ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額とマザーファンドの投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引想定元本の合計額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部解約を指図するものとします。

(ニ) 上記（ハ）において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該スワップ取引の想定元本の総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(ホ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

(ヘ) 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受け入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受け入れの指図を行うことができます。

## &lt;平成26年10月21日以降&gt;

## a. 運用の指図範囲

委託者は、信託金を、新光投信株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたインデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券のほか次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。有価証券は、本邦通貨表示のものに限ります。）で市場性のあるものに投資することを指図します。ただし、余裕金については、預金、指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）、コール・ローン、手形割引市場において売買される手形、貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものにより運用することの指図ができます。

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する証券で、前号の証券の性質を有するもの
3. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
4. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

## b. 先物

委託者は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、現物オプション取引は預金に限るものとします。

1. 先物取引の売り建ておよびコール・オプションの売り付けの指図は、建玉の合計額がヘッジ対象とする金利商品（以下、「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買い建ておよびプット・オプションの売り付けの指図は、建玉の合計額が、投資信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに余裕金の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買い付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の投資信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

## c. スワップ

(イ) 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件をもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

(ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

(ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額とマザーファンドの投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引想定元本の合計額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合に

は、委託者は速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部解約を指図するものとします。

(ニ) 上記(ハ)において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該スワップ取引の想定元本の総額の割合を乗じて得た額をいいます。

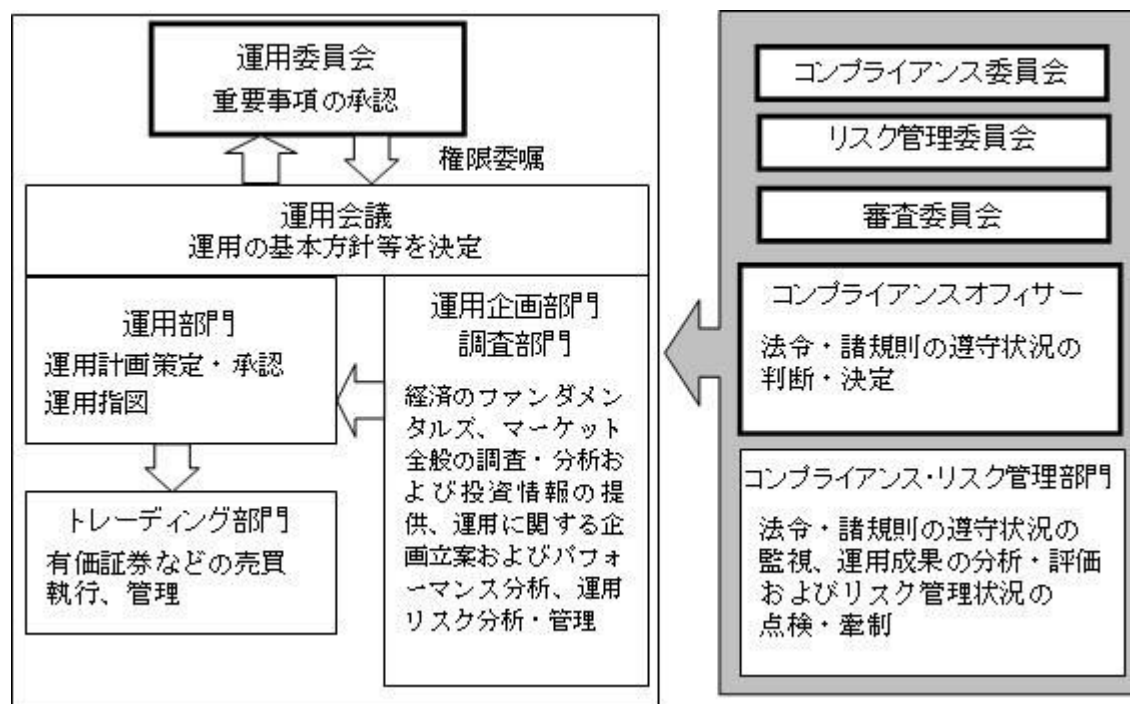
(ホ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

(ヘ) 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受け入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受け入れの指図を行うことができます。

### (3) 【運用体制】

#### a. ファンドの運用体制

<更新後>



上記運用体制は、今後変更になることがあります。

#### PLAN

- ・運用委員会から権限委嘱された運用会議を運用部署全体（運用部門、運用企画部門、調査部門）で開催し、アセットアロケーションの方針等の運用の基本方針を決定します。
- ・運用担当者はこの運用の基本方針を踏まえ、運用計画を作成します。
- ・運用計画は運用調査本部長および副本部長により承認されます。

#### DO

- ・ファンドマネージャーは承認された運用計画に基づいて指図を行います。
- ・売買の執行・管理はトレーディング部門が行います。

#### SEE

- ・コンプライアンス・リスク管理部門（20名程度）は日々の運用指図および売買執行について法

令・諸規則の遵守状況の点検を行い、必要に応じて運用部門を牽制します。

- ・運用企画部門は日々の運用リスク等の管理のほか、投資信託財産のパフォーマンス分析を行います。
- ・コンプライアンス・リスク管理部門およびコンプライアンスオフィサー（1名）は月次で開催される審査委員会、コンプライアンス委員会、リスク管理委員会において運用成果、法令・諸規則・約款の遵守状況、運用リスク管理状況等について検証・報告を行います。

#### < 受託者に対する管理体制 >

投資信託財産の管理業務を通じ、受託者の信託事務の正確性・迅速性、システム対応力等を総合的に検証しています。また、受託者より内部統制の整備および運用状況の報告書を受け取っています。

### （５）【投資制限】

#### < 訂正前 >

投資信託約款に定める投資制限

#### a．マザーファンド受益証券への投資割合

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割合には、制限を設けません。

#### b．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

#### c．有価証券の貸し付けの指図および範囲

（イ）委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けの指図をすることができます。

１．株式の貸し付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

２．公社債の貸し付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

（ロ）上記（イ）に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

（ハ）委託者は有価証券の貸し付けにあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

#### d．資金の借り入れ

（イ）委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、投資信託財産において一部解約金の支払資金に不足額が生じるときは、資金借り入れの指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

（ロ）資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

１．一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受け取りの確定している資金の額の範囲内。

２．一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内。

３．借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%以内。

（ハ）借入期間は、有価証券等の売却代金の入金日までに限るものとします。

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支払われます。

#### e．受託者の自己または利害関係人等との取引

（イ）受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及



び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者および受託者の利害関係人、信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の投資信託財産との間で、約款に定める範囲内の資産への投資を、信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない限り行うことができます。

(口) 上記(イ)の取り扱い、約款に定める範囲内での委託者の指図による取引についても同様とします。

法令に定める投資制限

a. 同一の法人の発行する株式

委託者は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託者に指図しないものとします。

(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

<訂正後>

<平成26年10月20日まで>

投資信託約款に定める投資制限

a. マザーファンド受益証券への投資割合

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割合には、制限を設けません。

b. 外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

c. 有価証券の貸し付けの指図および範囲

(イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けの指図をすることができます。

1. 株式の貸し付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

2. 公社債の貸し付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

(ロ) 上記(イ)に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

(ハ) 委託者は有価証券の貸し付けにあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

d. 資金の借り入れ

(イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、投資信託財産において一部解約金の支払資金に不足額が生じるときは、資金借り入れの指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

(ロ) 資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受け取りの確定している資金の額の範囲内。

2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内。

3. 借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%以内。

(ハ) 借入期間は、有価証券等の売却代金の入金日までに限るものとします。

(ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支払われます。

e. 受託者の自己または利害関係人等との取引

(イ) 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者および受託者の利害関係人、信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の投資信託財産との間で、約款に定める範囲内での資産への投資を、信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない限り行うことができます。

(ロ) 上記(イ)の取り扱いは、約款に定める範囲内での委託者の指図による取引についても同様とします。

法令に定める投資制限

a. 同一の法人の発行する株式

委託者は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託者に指図しないものとします。

(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

<平成26年10月21日以降>

投資信託約款に定める投資制限

a. マザーファンド受益証券への投資割合

インデックス マネジメント ファンド 225マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。

b. 外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

c. 有価証券の貸し付けの指図および範囲

(イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けの指図をすることができます。

1. 株式の貸し付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

2. 公社債の貸し付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

(ロ) 上記(イ)に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

(ハ) 委託者は有価証券の貸し付けにあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

d. 資金の借り入れ

(イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、投資信託財産において一部解約金の支払資金に不足額が生じるときは、資金借り入れの指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

(ロ) 資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受け取りの確定している資金の額の範囲内。

2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内。

3. 借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%以内。

(ハ) 借入期間は、有価証券等の売却代金の入金日までに限るものとします。

(ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支払われます。

e . 受託者の自己または利害関係人等との取引

(イ) 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者および受託者の利害関係人、信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の投資信託財産との間で、約款に定める範囲内の資産への投資を、信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない限り行うことができます。

(ロ) 上記(イ)の取り扱いは、約款に定める範囲内での委託者の指図による取引についても同様とします。

法令に定める投資制限

a . 同一の法人の発行する株式

委託者は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託者に指図しないものとします。

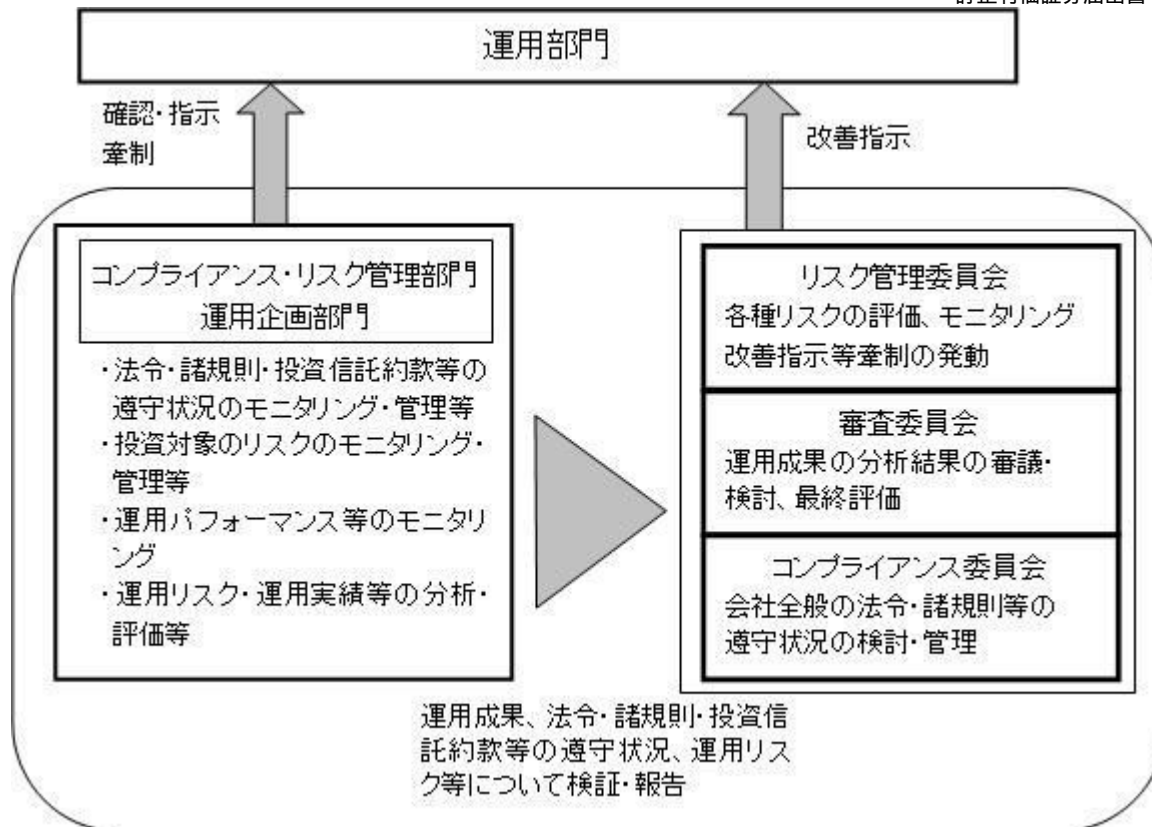
(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

### 3【投資リスク】

#### (2) リスク管理体制

<更新後>

パフォーマンスの分析・管理	: 運用成果を分析し、その結果を審議・検討してその評価を行います。
運用リスクの管理	: 投資信託財産の運用リスクの管理およびその管理の現状・適正性を把握し、管理方針を協議、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。



上記リスク管理体制は、今後変更になることがあります。

## 5【運用状況】

平成26年10月21日以降、当ファンドの主要投資対象である「ミリオン・インデックスマザーファンド受益証券」を「インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド受益証券」に変更します。ご参考として、平成26年10月21日以降、当ファンドが投資を行う「インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド受益証券」の投資状況および投資資産を記載します。

<追加後>

### (1)【投資状況】

インデックスポートフォリオ

(略)

(参考)ミリオン・インデックスマザーファンド

(略)

(参考)インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド

(平成26年 6月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	27,815,774,400	95.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,410,320,501	4.82
純資産総額		29,226,094,901	100.00

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

## (2) 【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

インデックスポートフォリオ

(略)

(参考) ミリオン・インデックスマザーファンド

(略)

(参考) インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

(平成26年 6月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	72,000	39,015.00	2,809,080,000	33,330.00	2,399,760,000	8.21
2	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	216,000	8,741.00	1,888,056,000	7,543.00	1,629,288,000	5.57
3	日本	株式	ファナック	電気機器	72,000	17,270.00	1,243,440,000	17,470.00	1,257,840,000	4.30
4	日本	株式	KDDI	情報・通信業	144,000	6,209.00	894,096,000	6,179.00	889,776,000	3.04
5	日本	株式	京セラ	電気機器	144,000	4,921.00	708,624,000	4,808.00	692,352,000	2.36
6	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	144,000	4,115.00	592,560,000	3,537.00	509,328,000	1.74
7	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	72,000	5,579.00	401,688,000	6,848.00	493,056,000	1.68
8	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	360,000	1,205.40	433,944,000	1,331.00	479,160,000	1.63
9	日本	株式	ダイキン工業	機械	72,000	6,004.00	432,288,000	6,392.00	460,224,000	1.57
10	日本	株式	セコム	サービス業	72,000	5,890.00	424,080,000	6,190.00	445,680,000	1.52
11	日本	株式	信越化学工業	化学	72,000	5,750.00	414,000,000	6,158.00	443,376,000	1.51
12	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	72,000	6,144.00	442,368,000	6,084.00	438,048,000	1.49

13	日本	株式	キヤノン	電気機器	108,000	3,210.00	346,680,000	3,296.00	355,968,000	1.21
14	日本	株式	デンソー	輸送用機器	72,000	5,466.00	393,552,000	4,835.00	348,120,000	1.19
15	日本	株式	T D K	電気機器	72,000	4,680.00	336,960,000	4,750.00	342,000,000	1.17
16	日本	株式	日東電工	化学	72,000	4,244.00	305,568,000	4,747.00	341,784,000	1.16
17	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	72,000	4,782.00	344,304,000	4,699.00	338,328,000	1.15
18	日本	株式	テルモ	精密機器	144,000	2,392.50	344,520,000	2,265.00	326,160,000	1.11
19	日本	株式	住友不動産	不動産業	72,000	4,809.00	346,248,000	4,347.00	312,984,000	1.07
20	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	72,000	4,267.00	307,224,000	4,268.00	307,296,000	1.05
21	日本	株式	エーザイ	医薬品	72,000	3,926.00	282,672,000	4,244.00	305,568,000	1.04
22	日本	株式	電通	サービス業	72,000	4,020.00	289,440,000	4,125.00	297,000,000	1.01
23	日本	株式	花王	化学	72,000	3,207.00	230,904,000	3,987.00	287,064,000	0.98
24	日本	株式	エヌ・ティ・ティ・データ	情報・通信業	72,000	3,555.00	255,960,000	3,890.00	280,080,000	0.95
25	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	72,000	3,172.00	228,384,000	3,693.00	265,896,000	0.90
26	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	72,000	3,846.00	276,912,000	3,545.00	255,240,000	0.87
27	日本	株式	オリンパス	精密機器	72,000	3,080.00	221,760,000	3,490.00	251,280,000	0.85
28	日本	株式	三井不動産	不動産業	72,000	3,501.00	252,072,000	3,416.00	245,952,000	0.84
29	日本	株式	トレンドマイクロ	情報・通信業	72,000	3,300.00	237,600,000	3,335.00	240,120,000	0.82
30	日本	株式	アサヒグループホールディングス	食料品	72,000	2,769.00	199,368,000	3,180.00	228,960,000	0.78

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

(平成26年 6月30日現在)

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.15
		建設業	2.98
		食料品	4.35
		繊維製品	0.53
		パルプ・紙	0.26

化学	6.76
医薬品	6.15
石油・石炭製品	0.41
ゴム製品	1.08
ガラス・土石製品	1.67
鉄鋼	0.32
非鉄金属	1.50
金属製品	0.40
機械	5.03
電気機器	16.22
輸送用機器	6.94
精密機器	2.56
その他製品	0.84
電気・ガス業	0.31
陸運業	2.29
海運業	0.21
空運業	0.05
倉庫・運輸関連業	0.37
情報・通信業	11.26
卸売業	2.48
小売業	10.70
銀行業	1.28
証券、商品先物取引業	0.64
保険業	0.94
その他金融業	0.51
不動産業	3.03
サービス業	2.65
合計	95.17

## 【投資不動産物件】

インデックスポートフォリオ

(略)

(参考) ミリオン・インデックスマザーファンド

(略)

（参考）インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

インデックスポートフォリオ

（略）

（参考）ミリオン・インデックスマザーファンド

（略）

（参考）インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド

（平成26年 6月30日現在）

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 （円）	評価額 （円）	投資比率 （％）
株価指数先物 取引	大阪取引所	日経平均株価先物取引	買建	81	日本円	1,218,821,480	1,227,960,000	4.20

(注)時価評価にあたっては、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

第2【管理及び運営】

3【資産管理等の概要】

(5)【その他】

<訂正前>

（略）

d. 運用報告書

当ファンドについて、委託者は各計算期間の終了時および償還時に、期中の運用経過のほか、投資信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成します。

運用報告書は、あらかじめ受益者が申し出た住所に販売会社から届けられます。また、販売会社で受け取ることができます。

（略）

<訂正後>

（略）



## d．運用報告書

当ファンドについて、委託者は各計算期間の終了時および償還時に運用報告書を作成します。

運用報告書は、あらかじめ受益者が申し出た住所に販売会社から届けられます。また、販売会社で受け取ることができます。

なお、平成26年12月1日以降に作成期日が到来するものについては交付運用報告書を作成・交付する予定です。

（略）

## 第3【ファンドの経理状況】

## 2【ファンドの現況】

平成26年10月21日以降、当ファンドの主要投資対象である「ミリオン・インデックスマザーファンド受益証券」を「インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド受益証券」に変更します。

ご参考として、平成26年10月21日以降、当ファンドが投資を行う「インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド受益証券」のファンドの現況を記載します。

<追加後>

## 【純資産額計算書】

インデックスポートフォリオ

(略)

(参考)ミリオン・インデックスマザーファンド

(略)

(参考)インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド

(平成26年 6月30日現在)

資産総額	29,410,094,901円
負債総額	184,000,000円
純資産総額( - )	29,226,094,901円
発行済口数	16,822,944,954口
1口当たり純資産額( / )	1.7373円
(1万口当たり純資産額)	(17,373円)

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

<訂正前>

a．資本金の額（平成26年5月末現在）

資本金の額	45億2,430万円
会社が発行する株式総数	3,000,000株
発行済株式総数	1,823,250株
直近5ヵ年における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。	

<訂正後>

a．資本金の額（平成26年6月末現在）

資本金の額	45億2,430万円
会社が発行する株式総数	3,000,000株
発行済株式総数	1,823,250株
直近5ヵ年における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。	

##### 2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託者は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

委託者が運用を行っている証券投資信託（親投資信託は除きます。）は以下のとおりです。

（平成26年6月30日現在）

種類	ファンド本数	純資産額（百万円）
総合計	270	3,666,004
株式投資信託（合計）	242	2,991,195
単位型	26	156,923
追加型	216	2,834,272
公社債投資信託（合計）	28	674,808
単位型	1	777
追加型	27	674,030

#### 第2【その他の関係法人の概況】

##### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## &lt;訂正前&gt;

## (1) 三井住友信託銀行株式会社（「受託者」）

## a. 資本金の額

平成26年5月末現在、342,037百万円

## b. 事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むと共に、金融機関の信託業務の兼営に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

## (2) みずほ証券株式会社（「販売会社」）

## a. 資本金の額

平成26年5月末現在、125,167百万円

## b. 事業の内容

金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

## &lt;訂正後&gt;

## (1) 三井住友信託銀行株式会社（「受託者」）

## a. 資本金の額

平成26年6月末現在、342,037百万円

## b. 事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むと共に、金融機関の信託業務の兼営に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

## (2) みずほ証券株式会社（「販売会社」）

## a. 資本金の額

平成26年6月末現在、125,167百万円

## b. 事業の内容

金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。