

平成26年7月期（平成26年1月17日～平成26年7月16日）決算短信

平成26年8月25日

ファンド名 MAXIS 日経225上場投信
 コード番号 1346
 連動対象指標 日経平均株価
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 三菱UFJ投信株式会社
 代表者名 取締役社長 金上 孝
 問合せ先責任者 商品ディスクロージャー部長 井上 靖

上場取引所 東証

URL <http://www.am.mufg.jp/>

TEL (03)6250-4910

有価証券報告書提出予定日 平成26年10月15日

分配金支払開始予定日 平成26年8月22日

I ファンドの運用状況

1. 平成26年7月期の運用状況（平成26年1月17日～平成26年7月16日）

(1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計（純資産）	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
平成26年7月期	560,366	(99.7)	1,628	(0.3)	561,994	(100.0)
平成26年1月期	444,572	(99.7)	1,390	(0.3)	445,963	(100.0)

(2) 設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
平成26年7月期	27,778	12,825	4,827	35,776
平成26年1月期	19,098	21,462	12,782	27,778

(3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	1口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
平成26年7月期	566,168	4,173	561,994	15,709
平成26年1月期	448,780	2,817	445,963	16,054

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
平成26年7月期	100
平成26年1月期	86

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 無
 ② ①以外の変更 無

II 財務諸表等

【MAXIS 日経225上場投信】

(1) 【貸借対照表】

	第10期 [平成26年1月16日現在]	第11期 [平成26年7月16日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,599,823,530	5,075,714,449
株式	444,572,313,400	560,366,449,500
派生商品評価勘定	7,420,400	24,783,416
未収入金	21,284,640	65,938,376
未収配当金	428,212,800	492,740,000
未収利息	5,675	7,368
差入委託証拠金	151,830,000	142,380,000
流動資産合計	448,780,890,445	566,168,013,109
資産合計	448,780,890,445	566,168,013,109
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,220,160	—
前受金	32,215,000	98,526,000
未払収益分配金	2,388,936,122	3,577,644,100
未払受託者報酬	133,151,038	169,269,259
未払委託者報酬	190,215,696	241,813,168
その他未払費用	66,064,485	85,899,716
流動負債合計	2,817,802,501	4,173,152,243
負債合計	2,817,802,501	4,173,152,243
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	204,920,718,279	263,922,805,257
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	241,042,369,665	298,072,055,609
(分配準備積立金)	(4,454,079)	(9,544,267)
元本等合計	445,963,087,944	561,994,860,866
純資産合計	445,963,087,944	561,994,860,866
負債純資産合計	448,780,890,445	566,168,013,109

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第10期 自平成25年7月17日 至平成26年1月16日	第11期 自平成26年1月17日 至平成26年7月16日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	2,768,843,600	4,078,807,928
受取利息	739,904	598,293
有価証券売買等損益	29,051,529,427	△5,333,617,186
派生商品取引等損益	269,466,960	204,966,400
その他収益	584,257	517,162
営業収益合計	32,091,164,148	△1,048,727,403
営業費用		
受託者報酬	133,151,038	169,269,259
委託者報酬	190,215,696	241,813,168
その他費用 ※1	66,277,835	86,106,668
営業費用合計	389,644,569	497,189,095
営業利益	31,701,519,579	△1,545,916,498
経常利益	31,701,519,579	△1,545,916,498
当期純利益	31,701,519,579	△1,545,916,498
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額	—	—
期首剰余金又は期首欠損金(△)	143,088,868,129	241,042,369,665
剰余金増加額又は欠損金減少額	166,923,828,573	100,784,843,299
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	166,923,828,573	100,784,843,299
剰余金減少額又は欠損金増加額	98,282,910,494	38,631,596,757
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	98,282,910,494	38,631,596,757
分配金 ※2	2,388,936,122	3,577,644,100
期末剰余金又は期末欠損金(△)	241,042,369,665	298,072,055,609

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引は個別法に基づき、金融商品取引所等における清算値段で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

	第10期 [平成26年1月16日現在]	第11期 [平成26年7月16日現在]
※1 期首元本額		
期中追加設定元本額	140,889,044,340円	204,920,718,279円
期中一部交換元本額	158,328,751,845円	94,614,989,721円
	94,297,077,906円	35,612,902,743円
2 受益権の総数	27,778,327口	35,776,441口
3 1口当たり純資産額	16,054円	15,709円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期(自平成25年7月17日 至平成26年1月16日)

※1 その他費用
上場費用および商標使用料等を含んでおります。

※2 分配金の計算過程

当期配当等収益額	A	2,770,167,761円
分配準備積立金額	B	12,867,009円
配当等収益合計額	C=A+B	2,783,034,770円
経費	D	389,644,569円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	2,393,390,201円
収益分配金金額	F	2,388,936,122円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	4,454,079円
当ファンドの期末残存口数	H	27,778,327口
1口当たり分配金額	I=F/H	86円

第11期(自平成26年1月17日 至平成26年7月16日)

※1 その他費用
上場費用および商標使用料等を含んでおります。

※2 分配金の計算過程

当期配当等収益額	A	4,079,923,383円
分配準備積立金額	B	4,454,079円
配当等収益合計額	C=A+B	4,084,377,462円
経費	D	497,189,095円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	3,587,188,367円
収益分配金金額	F	3,577,644,100円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	9,544,267円
当ファンドの期末残存口数	H	35,776,441口
1口当たり分配金額	I=F/H	100円

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	第10期 (自平成25年7月17日 至平成26年1月16日)	第11期 (自平成26年1月17日 至平成26年7月16日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同 左
	当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。	同 左
	また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同 左

区分	第10期 (自平成25年7月17日 至平成26年1月16日)	第11期 (自平成26年1月17日 至平成26年7月16日)
3 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第10期 [平成26年1月16日現在]	第11期 [平成26年7月16日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引等関係に関する注記)に記載しております。 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同 左 同 左 同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同 左

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第10期 [平成26年1月16日現在]	第11期 [平成26年7月16日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	26,095,477,770	△2,336,477,306
合計	26,095,477,770	△2,336,477,306

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

区分	種類	第10期 [平成26年1月16日現在]			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,398,805,000	—	1,399,080,000	275,000
	合計	1,398,805,000	—	1,399,080,000	275,000

区分	種類	第11期 [平成26年7月16日現在]			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,605,405,000	—	1,630,280,000	24,875,000
	合計	1,605,405,000	—	1,630,280,000	24,875,000

(注) 時価の算定方法

- 1 先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。