

# 平成28年7月期（平成28年1月17日～平成28年7月16日）決算短信

平成28年8月22日

ファンド名 MAXIS 日経225上場投信

上場取引所 東証

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国際投信株式会社

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

代表者名 取締役社長 松田 通

問合せ先責任者 ディスクロージャー部 宇野 誠朗

TEL (03)6250-4910

有価証券報告書提出予定日 平成28年10月14日

分配金支払開始予定日 平成28年8月24日

## I ファンドの運用状況

### 1. 平成28年7月期の運用状況（平成28年1月17日～平成28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28年7月期	760,467	( 99.6 )	2,802	( 0.4 )	763,270	( 100.0 )
平成28年1月期	741,345	( 99.8 )	1,129	( 0.2 )	742,475	( 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28年7月期	42,330	11,511	8,616	45,225
平成28年1月期	32,943	19,920	10,533	42,330

#### (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28年7月期	770,940	7,669	763,270	16,877
平成28年1月期	749,282	6,807	742,475	17,540

#### (4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
平成28年7月期	150
平成28年1月期	123

### 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14期	第15期
	[平成28年1月16日現在]	[平成28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	5,788,678,140	8,081,106,197
株式	741,345,615,360	760,467,725,440
派生商品評価勘定	—	99,407,984
未収入金	—	874,211,824
未収配当金	1,131,986,000	1,019,304,000
未収利息	18,586	—
前払金	782,210,000	—
差入委託証拠金	233,730,000	398,250,000
流動資産合計	749,282,238,086	770,940,005,445
資産合計	749,282,238,086	770,940,005,445
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	116,406,160	—
前受金	—	78,306,000
未払金	729,366,768	—
未払収益分配金	5,206,689,015	6,783,817,050
未払受託者報酬	261,570,293	270,955,753
未払委託者報酬	374,619,604	387,637,152
未払利息	—	20,066
その他未払費用	118,389,178	148,708,634
流動負債合計	6,807,041,018	7,669,444,655
負債合計	6,807,041,018	7,669,444,655
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	312,274,348,485	333,628,122,519
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	430,200,848,583	429,642,438,271
(分配準備積立金)	(23,274,128)	(32,586,340)
元本等合計	742,475,197,068	763,270,560,790
純資産合計	742,475,197,068	763,270,560,790
負債純資産合計	749,282,238,086	770,940,005,445

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

	第14期 自平成27年7月17日 至平成28年1月16日	第15期 自平成28年1月17日 至平成28年7月16日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	5,966,288,900	7,600,116,452
受取利息	1,050,090	266,354
有価証券売買等損益	△139,743,441,692	△30,994,899,710
派生商品取引等損益	△539,935,104	△178,313,808
その他収益	895,554	895,964
営業収益合計	△134,315,142,252	△23,571,934,748
営業費用		
支払利息	—	513,619
受託者報酬	261,570,293	270,955,753
委託者報酬	374,619,604	387,637,152
その他費用 ※1	118,649,166	149,042,984
営業費用合計	754,839,063	808,149,508
営業利益又は営業損失(△)	△135,069,981,315	△24,380,084,256
経常利益又は経常損失(△)	△135,069,981,315	△24,380,084,256
当期純利益又は当期純損失(△)	△135,069,981,315	△24,380,084,256
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額(△)	—	—
期首剰余金又は期首欠損金(△)	450,641,083,805	430,200,848,583
剰余金増加額又は欠損金減少額	241,858,545,633	110,769,673,567
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	241,858,545,633	110,769,673,567
剰余金減少額又は欠損金増加額	122,022,110,525	80,164,182,573
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	122,022,110,525	80,164,182,573
分配金 ※2	5,206,689,015	6,783,817,050
期末剰余金又は期末欠損金(△)	430,200,848,583	429,642,438,271

(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 14 期 [ 平成28年1月16日現在 ]	第 15 期 [ 平成28年7月16日現在 ]
※ 1 期首元本額	243,025,047,855円	312,274,348,485円
期中追加設定元本額	146,955,335,865円	84,919,619,931円
期中一部交換元本額	77,706,035,235円	63,565,845,897円
2 受益権の総数	42,330,805口	45,225,447口
3 1口当たり純資産額	17,540円	16,877円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 14 期 (自 平成27年7月17日 至 平成28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	5,968,234,544円
分配準備積立金額	B	16,567,662円
配当等収益合計額	C=A+B	5,984,802,206円
経費	D	754,839,063円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	5,229,963,143円
収益分配金金額	F	5,206,689,015円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	23,274,128円
当ファンドの期末残存口数	H	42,330,805口
1口当たり分配金額	I=F/H	123円

第 15 期 (自 平成28年1月17日 至 平成28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	7,600,765,151円
分配準備積立金額	B	23,274,128円
配当等収益合計額	C=A+B	7,624,039,279円
経費	D	807,635,889円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	6,816,403,390円
収益分配金金額	F	6,783,817,050円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	32,586,340円
当ファンドの期末残存口数	H	45,225,447口
1口当たり分配金額	I=F/H	150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 14 期 (自 平成27年 7月17日 至 平成28年 1月16日 )	第 15 期 (自 平成28年 1月17日 至 平成28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14期 (自平成27年7月17日 至平成28年1月16日)	第15期 (自平成28年1月17日 至平成28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14期 [平成28年1月16日現在]	第15期 [平成28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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第14期 [平成28年1月16日現在]	第15期 [平成28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	△119,334,003,746	△22,940,111,920
合計	△119,334,003,746	△22,940,111,920

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

区分	種類	第14期 [平成28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	1,231,100,000	—	1,114,750,000	△116,350,000
	合計	1,231,100,000	—	1,114,750,000	△116,350,000

区分	種類	第15期 [平成28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	2,699,086,000	—	2,798,640,000	99,554,000
	合計	2,699,086,000	—	2,798,640,000	99,554,000

(注) 時価の算定方法

- 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。
- 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(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。