

平成29年7月期（平成29年1月17日～平成29年7月16日）決算短信

平成29年8月21日

ファンド名 MAXIS JAPAN クオリティ150 上場投信 上場取引所 東証
 コード番号 1460
 連動対象指標 iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150 インデックス
 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29年10月13日
 分配金支払開始予定日 平成29年8月24日

I ファンドの運用状況

1. 平成29年7月期の運用状況（平成29年1月17日～平成29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29年7月期	847	(98.0)	17	(2.0)	864	(100.0)
平成29年1月期	780	(98.5)	11	(1.5)	792	(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29年7月期	47	—	—	47
平成29年1月期	77	—	29	47

(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29年7月期	873	9	864	18,064
平成29年1月期	799	7	792	16,551

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
平成29年7月期	164
平成29年1月期	107

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 JAPAN クオリティ150上場投信】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 [平成29年1月16日現在]	第3期 [平成29年7月16日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	16,510,863	24,527,913
株式	780,487,550	847,336,240
派生商品評価勘定	664,460	229,460
未収配当金	1,326,300	1,305,010
差入委託証拠金	660,000	495,000
流動資産合計	799,649,173	873,893,623
資産合計	799,649,173	873,893,623
負債の部		
流動負債		
前受金	825,000	180,000
未払収益分配金	5,121,555	7,849,860
未払受託者報酬	165,206	175,745
未払委託者報酬	825,967	878,654
未払利息	23	105
その他未払費用	508,047	185,761
流動負債合計	7,445,798	9,270,125
負債合計	7,445,798	9,270,125
純資産の部		
元本等		
元本	715,103,100	715,103,100
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	77,100,275	149,520,398
(分配準備積立金)	25,552	703
元本等合計	792,203,375	864,623,498
純資産合計	792,203,375	864,623,498
負債純資産合計	799,649,173	873,893,623

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自 平成28年7月17日 至 平成29年1月16日		自 平成29年1月17日 至 平成29年7月16日	
営業収益				
受取配当金		6,578,167		9,066,190
受取利息		70		91
有価証券売買等損益		93,598,529		71,319,132
派生商品取引等損益		2,187,840		1,125,840
その他収益		17,515		6,957
営業収益合計		102,382,121		81,518,210
営業費用				
支払利息		3,787		4,261
受託者報酬		165,206		175,745
委託者報酬		825,967		878,654
その他費用		510,984		189,567
営業費用合計		1,505,944		1,248,227
営業利益又は営業損失(△)		100,876,177		80,269,983
経常利益又は経常損失(△)		100,876,177		80,269,983
当期純利益又は当期純損失(△)		100,876,177		80,269,983
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(△)		△28,398,407		77,100,275
剰余金増加額又は欠損金減少額		9,744,060		-
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		9,744,060		-
分配金		5,121,555		7,849,860
期末剰余金又は期末欠損金(△)		77,100,275		149,520,398

(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2期 [平成29年1月16日現在]	第3期 [平成29年7月16日現在]
1 期首元本額	1,157,147,820円	715,103,100円
期中追加設定元本額	—	—
期中一部交換元本額	442,044,720円	—
2 受益権の総数	47,865口	47,865口
3 1口当たり純資産額	16,551円	18,064円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期(自平成28年7月17日 至平成29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	6,591,965円
分配準備積立金額	B	57,299円
配当等収益合計額	C=A+B	6,649,264円
経費	D	1,502,157円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	5,147,107円
収益分配金金額	F	5,121,555円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	25,552円
当ファンドの期末残存口数	H	47,865口
1口当たり分配金額	I=F/H	107円

第3期(自平成29年1月17日 至平成29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	9,068,977円
分配準備積立金額	B	25,552円
配当等収益合計額	C=A+B	9,094,529円
経費	D	1,243,966円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	7,850,563円
収益分配金金額	F	7,849,860円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	703円
当ファンドの期末残存口数	H	47,865口
1口当たり分配金額	I=F/H	164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2期 (自平成28年7月17日 至平成29年1月16日)	第3期 (自平成29年1月17日 至平成29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2期 (自平成28年7月17日 至平成29年1月16日)	第3期 (自平成29年1月17日 至平成29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2期 [平成29年1月16日現在]	第3期 [平成29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2期 [平成29年1月16日現在]	第3期 [平成29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	62,705,895	59,072,204
合計	62,705,895	59,072,204

(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2期 [平成29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	14,610,000	—	15,275,000	665,000
	合計	14,610,000	—	15,275,000	665,000

区分	種類	第3期 [平成29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	16,015,000	—	16,245,000	230,000
	合計	16,015,000	—	16,245,000	230,000

(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。