

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 設備・人材積極投資企業200上 上場取引所 東証
場投信

コード番号 1485

連動対象指標 iSTOXX MUTB Japan 積極投資企業200
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	4,353	(99.5)	19	(0.5)	4,373	(100.0)
平成29年1月期	4,030	(99.6)	16	(0.4)	4,047	(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	182	—	—	182
平成29年1月期	—	182	—	182

(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	4,419	46	4,373	23,960
平成29年1月期	4,086	39	4,047	22,173

(4)分配金

	1口当たり分配金
	円
平成29年7月期	215
平成29年1月期	170

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 設備・人材積極投資企業200上場投信】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 [平成29年1月16日現在]	第2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	46,656,443	57,955,622
株式	4,030,437,150	4,353,548,180
派生商品評価勘定	659,460	224,460
未収入金	1,377,840	457,840
未収配当金	5,560,550	6,242,520
差入委託証拠金	1,980,000	1,485,000
流動資産合計	4,086,671,443	4,419,913,622
資産合計	4,086,671,443	4,419,913,622
負債の部		
流動負債		
前受金	2,460,000	525,000
未払収益分配金	31,030,610	39,244,595
未払受託者報酬	826,386	893,346
未払委託者報酬	3,718,701	4,019,960
未払利息	67	250
その他未払費用	1,399,242	1,689,301
流動負債合計	39,435,006	46,372,452
負債合計	39,435,006	46,372,452
純資産の部		
元本等		
元本	3,267,523,233	3,267,523,233
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	779,713,204	1,106,017,937
(分配準備積立金)	117,776	53,443
元本等合計	4,047,236,437	4,373,541,170
純資産合計	4,047,236,437	4,373,541,170
負債純資産合計	4,086,671,443	4,419,913,622

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期		第2期	
	自 平成28年6月27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		37,032,784		45,741,649
受取利息		126		193
有価証券売買等損益		643,548,470		323,357,546
派生商品取引等損益		7,047,656		3,011,520
その他収益		65,203		51,737
営業収益合計		687,694,239		372,162,645
営業費用				
支払利息		5,398		7,540
受託者報酬		826,386		893,346
委託者報酬		3,718,701		4,019,960
その他費用		1,399,242		1,692,471
営業費用合計		5,949,727		6,613,317
営業利益又は営業損失(△)		681,744,512		365,549,328
経常利益又は経常損失(△)		681,744,512		365,549,328
当期純利益又は当期純損失(△)		681,744,512		365,549,328
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(△)		-		779,713,204
剰余金増加額又は欠損金減少額		128,999,302		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		128,999,302		-
分配金		31,030,610		39,244,595
期末剰余金又は期末欠損金(△)		779,713,204		1,106,017,937

(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1期 [平成29年1月16日現在]	第2期 [平成29年7月16日現在]
1 期首元本額	—	3,267,523,233円
期中追加設定元本額	3,267,523,233円	—
期中一部交換元本額	—	—
2 受益権の総数	182,533口	182,533口
3 1口当たり純資産額	22,173円	23,960円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期（自平成28年6月27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	37,092,715円
分配準備積立金額	B	—
配当等収益合計額	C=A+B	37,092,715円
経費	D	5,944,329円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	31,148,386円
収益分配金金額	F	31,030,610円
次期繰越金（分配準備積立金）	G=E-F	117,776円
当ファンドの期末残存口数	H	182,533口
1口当たり分配金額	I=F/H	170円

第2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	45,786,039円
分配準備積立金額	B	117,776円
配当等収益合計額	C=A+B	45,903,815円
経費	D	6,605,777円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	39,298,038円
収益分配金金額	F	39,244,595円
次期繰越金（分配準備積立金）	G=E-F	53,443円
当ファンドの期末残存口数	H	182,533口
1口当たり分配金額	I=F/H	215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1期 (自平成28年6月27日 至平成29年1月16日)	第2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1期 (自平成28年6月27日 至平成29年1月16日)	第2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1期 [平成29年1月16日現在]	第2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1期 [平成29年1月16日現在]	第2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	512,300,141	312,173,859
合計	512,300,141	312,173,859

(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1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	14,615,000	—	15,275,000	660,000
	合計	14,615,000	—	15,275,000	660,000

区分	種類	第2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	16,020,000	—	16,245,000	225,000
	合計	16,020,000	—	16,245,000	225,000

(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。