

平成30年1月期（平成29年7月17日～平成30年1月16日）決算短信

平成30年2月22日

ファンド名 MAXIS トピックス上場投信
 コード番号 1348
 連動対象指標 TOPIX
 主要投資資産 株式
 売買単位 10口
 管理会社 三菱UFJ国際投信株式会社
 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

上場取引所 東証

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

TEL (03)6250-4910

有価証券報告書提出予定日 平成30年 4月13日
 分配金支払開始予定日 平成30年 2月23日

I ファンドの運用状況

1. 平成30年1月期の運用状況（平成29年7月17日～平成30年1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30年1月期	978,635	(99.2)	8,235	(0.8)	986,871	(100.0)
平成29年7月期	719,360	(99.5)	3,919	(0.5)	723,279	(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30年1月期	435,321	188,680	115,333	508,668
平成29年7月期	336,688	161,513	62,880	435,321

(3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	100口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)×100)
	百万円	百万円	百万円	円
平成30年1月期	1,064,499	77,628	986,871	194,011
平成29年7月期	798,259	74,980	723,279	166,148

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
平成30年1月期	133
平成29年7月期	160

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 トピックス上場投信】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 16 期 [平成 29 年 7 月 16 日現在]	第 17 期 [平成 30 年 1 月 16 日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	77,256,856,826	83,503,972,043
株式	719,360,655,960	978,635,961,462
派生商品評価勘定	46,644,320	437,440,100
未収入金	444,476,880	391,243,440
未収配当金	799,938,083	1,148,672,163
その他未収収益	19,686,663	14,043,322
差入委託証拠金	331,650,000	368,280,000
流動資産合計	798,259,908,732	1,064,499,612,530
資産合計	798,259,908,732	1,064,499,612,530
負債の部		
流動負債		
前受金	109,575,000	765,620,000
未払金	355,119,582	-
未払収益分配金	6,965,149,280	6,765,284,852
未払受託者報酬	106,487,471	139,947,591
未払委託者報酬	173,769,929	231,136,982
未払利息	335,209	129,625
受入担保金	67,159,022,332	69,593,378,190
その他未払費用	110,653,441	132,555,779
流動負債合計	74,980,112,244	77,628,053,019
負債合計	74,980,112,244	77,628,053,019
純資産の部		
元本等		
元本	387,001,106,870	452,205,882,226
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	336,278,689,618	534,665,677,285
(分配準備積立金)	21,895,164	48,040,047
元本等合計	723,279,796,488	986,871,559,511
純資産合計	723,279,796,488	986,871,559,511
負債純資産合計	798,259,908,732	1,064,499,612,530

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 16 期		第 17 期	
	自 平成 29 年 1 月 17 日 至 平成 29 年 7 月 16 日		自 平成 29 年 7 月 17 日 至 平成 30 年 1 月 16 日	
営業収益				
受取配当金		7,255,759,858		7,238,394,319
受取利息		464,522		313,769
有価証券売買等損益		37,588,312,178		129,060,707,874
派生商品取引等損益		624,939,940		1,620,340,620
その他収益		114,250,227		79,377,285
営業収益合計		45,583,726,725		137,999,133,867
営業費用				
支払利息		20,758,451		22,323,680
受託者報酬		106,487,471		139,947,591
委託者報酬		173,769,929		231,136,982
その他費用		111,351,030		133,247,385
営業費用合計		412,366,881		526,655,638
営業利益又は営業損失 (△)		45,171,359,844		137,472,478,229
経常利益又は経常損失 (△)		45,171,359,844		137,472,478,229
当期純利益又は当期純損失 (△)		45,171,359,844		137,472,478,229
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 (△)		226,749,850,363		336,278,689,618
剰余金増加額又は欠損金減少額		114,410,093,952		170,263,527,276
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		114,410,093,952		170,263,527,276
剰余金減少額又は欠損金増加額		43,087,465,261		102,583,732,986
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		43,087,465,261		102,583,732,986
分配金		6,965,149,280		6,765,284,852
期末剰余金又は期末欠損金 (△)		336,278,689,618		534,665,677,285

(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16期 [平成29年7月16日現在]	第17期 [平成30年1月16日現在]
1 期首元本額	299,316,326,309円	387,001,106,870円
期中追加設定元本額	143,585,323,700円	167,736,697,800円
期中一部交換元本額	55,900,543,139円	102,531,922,444円
2 貸付有価証券 株券貸借取引契約により、以下の通り有価証券の貸付を行っております。 株式	64,155,504,400円	66,840,289,750円
3 受益権の総数	435,321,830口	508,668,034口
4 1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	1,661.48円 (166,148円)	1,940.11円 (194,011円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第16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	7,349,716,156円
分配準備積立金額	B	28,936,718円
配当等収益合計額	C=A+B	7,378,652,874円
経費	D	391,608,430円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	6,987,044,444円
収益分配金金額	F	6,965,149,280円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	21,895,164円
当ファンドの期末残存口数	H	435,321,830口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,600円

第17期 (自平成29年7月17日 至平成30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	7,295,761,693円
分配準備積立金額	B	21,895,164円
配当等収益合計額	C=A+B	7,317,656,857円
経費	D	504,331,958円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	6,813,324,899円
収益分配金金額	F	6,765,284,852円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	48,040,047円
当ファンドの期末残存口数	H	508,668,034口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,330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16期 (自平成29年1月17日 至平成29年7月16日)	第17期 (自平成29年7月17日 至平成30年1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

区 分	第 16 期 (自 平成29年 1月17日 至 平成29年 7月16日)	第 17 期 (自 平成29年 7月17日 至 平成30年 1月16日)
3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>当ファンドは、新株予約権証券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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	— 同 左 同 左 同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 16 期 [平成29年7月16日現在]	第 17 期 [平成30年1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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	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 16 期 [平成29年7月16日現在]	第 17 期 [平成30年1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	37,897,784,279	116,655,292,663
合計	37,897,784,279	116,655,292,663

(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 16 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	3,884,515,000	—	3,931,290,000	46,775,000
	合 計	3,884,515,000	—	3,931,290,000	46,775,000

区 分	種 類	第 17 期 [平成30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	7,794,700,000	—	8,232,375,000	437,675,000
	合 計	7,794,700,000	—	8,232,375,000	437,675,000

(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。

※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。