

# 平成30年7月期（平成30年1月17日～平成30年7月16日）決算短信

平成30年8月24日  
上場取引所 東証

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国際投信株式会社 URL <https://www.am.mufg.jp/>  
 代表者名 取締役社長 松田 通  
 問合せ先責任者 商品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30年10月15日  
 分配金支払開始予定日 平成30年8月24日

## I ファンドの運用状況

### 1. 平成30年7月期の運用状況（平成30年1月17日～平成30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30年7月期	1,410,440	(99.5)	7,626	(0.5)	1,418,067	(100.0)
平成30年1月期	1,376,208	(99.5)	7,196	(0.5)	1,383,405	(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7月期	56,373	18,197	13,404	61,167
平成30年1月期	48,490	16,220	8,336	56,373

(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30年7月期	1,526,341	108,273	1,418,067	23,183
平成30年1月期	1,394,265	10,860	1,383,405	24,540

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
平成30年7月期	178
平成30年1月期	157

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

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第18期 [平成30年1月16日現在]	第19期 [平成30年7月16日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	14,814,782,451	113,266,929,278
株式	1,376,208,728,960	1,410,440,711,280
派生商品評価勘定	381,278,000	80,296,400
未収入金	501,076,560	81,588,140
未収配当金	1,936,088,000	1,781,090,400
前払金	-	143,700,000
その他未収収益	-	4,639,336
差入委託証拠金	423,360,000	542,520,000
流動資産合計	1,394,265,313,971	1,526,341,474,834
資産合計	1,394,265,313,971	1,526,341,474,834
<b>負債の部</b>		
流動負債		
前受金	732,800,000	-
未払収益分配金	8,850,715,174	10,887,779,934
未払受託者報酬	411,336,897	448,481,790
未払委託者報酬	663,746,040	748,324,385
未払利息	22,997	903,528
受入担保金	-	95,944,412,256
その他未払費用	201,546,407	243,870,990
流動負債合計	10,860,167,515	108,273,772,883
負債合計	10,860,167,515	108,273,772,883
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	415,870,865,214	451,231,194,231
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	967,534,281,242	966,836,507,720
(分配準備積立金)	49,776,850	28,177,601
元本等合計	1,383,405,146,456	1,418,067,701,951
純資産合計	1,383,405,146,456	1,418,067,701,951
負債純資産合計	1,394,265,313,971	1,526,341,474,834

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第18期		第19期	
	自	平成29年7月17日 至 平成30年1月16日	自	平成30年1月17日 至 平成30年7月16日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		10,137,782,600		12,301,030,572
受取利息		71,299		17,174
有価証券売買等損益		209,220,685,464		△78,253,274,807
派生商品取引等損益		2,409,074,400		368,468,060
その他収益		903,967		26,012,573
<b>営業収益合計</b>		<b>221,768,517,730</b>		<b>△65,557,746,428</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		2,510,825		19,968,508
受託者報酬		411,336,897		448,481,790
委託者報酬		663,746,040		748,324,385
その他費用		201,788,100		244,104,951
<b>営業費用合計</b>		<b>1,279,381,862</b>		<b>1,460,879,634</b>
営業利益又は営業損失(△)		220,489,135,868		△67,018,626,062
経常利益又は経常損失(△)		220,489,135,868		△67,018,626,062
当期純利益又は当期純損失(△)		220,489,135,868		△67,018,626,062
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(△)		640,516,476,026		967,534,281,242
剰余金増加額又は欠損金減少額		238,162,684,106		284,891,243,061
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		238,162,684,106		284,891,243,061
剰余金減少額又は欠損金増加額		122,783,299,584		207,682,610,587
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		122,783,299,584		207,682,610,587
分配金		8,850,715,174		10,887,779,934
期末剰余金又は期末欠損金(△)		967,534,281,242		966,836,507,720

## (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18期 [平成30年1月16日現在]	第19期 [平成30年7月16日現在]
1. 期首元本額	357,712,116,876円	415,870,865,214円
期中追加設定元本額	119,656,135,074円	134,241,703,410円
期中一部交換元本額	61,497,386,736円	98,881,374,393円
2. 貸付有価証券 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	—	94,236,614,040円
3. 受益権の総数	56,373,982口	61,167,303口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第18期 自平成29年7月17日 至平成30年1月16日	第19期 自平成30年1月17日 至平成30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。	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	2. 分配金の計算過程																																																												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>10,136,247,041円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>41,116,020円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>10,177,363,061円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>1,276,871,037円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=C-D</td> <td>8,900,492,024円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>8,850,715,174円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>49,776,850円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>56,373,982口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金額</td> <td>I=F/H</td> <td>157円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	10,136,247,041円	分配準備積立金額	B	41,116,020円	配当等収益合計額	C=A+B	10,177,363,061円	経費	D	1,276,871,037円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	8,900,492,024円	収益分配金金額	F	8,850,715,174円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	49,776,850円	当ファンドの期末残存口数	H	56,373,982口	1口当たり分配金額	I=F/H	157円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>12,307,091,811円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>49,776,850円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>12,356,868,661円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>1,440,911,126円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=C-D</td> <td>10,915,957,535円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>10,887,779,934円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>28,177,601円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>61,167,303口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金額</td> <td>I=F/H</td> <td>178円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	12,307,091,811円	分配準備積立金額	B	49,776,850円	配当等収益合計額	C=A+B	12,356,868,661円	経費	D	1,440,911,126円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	10,915,957,535円	収益分配金金額	F	10,887,779,934円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	28,177,601円	当ファンドの期末残存口数	H	61,167,303口	1口当たり分配金額	I=F/H	178円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	10,136,247,041円																																																											
分配準備積立金額	B	41,116,020円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	10,177,363,061円																																																											
経費	D	1,276,871,037円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	8,900,492,024円																																																											
収益分配金金額	F	8,850,715,174円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	49,776,850円																																																											
当ファンドの期末残存口数	H	56,373,982口																																																											
1口当たり分配金額	I=F/H	157円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	12,307,091,811円																																																											
分配準備積立金額	B	49,776,850円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	12,356,868,661円																																																											
経費	D	1,440,911,126円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	10,915,957,535円																																																											
収益分配金金額	F	10,887,779,934円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	28,177,601円																																																											
当ファンドの期末残存口数	H	61,167,303口																																																											
1口当たり分配金額	I=F/H	178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18期 自平成29年7月17日 至平成30年1月16日	第19期 自平成30年1月17日 至平成30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	当ファンドは、株式に投資してありま	同左

<p>係るリスク</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>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
---------------------------------------	--	----

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第18期 [平成30年1月16日現在]	第19期 [平成30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ぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券	(1) 有価証券
	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。	同左
	(2) デリバティブ取引	(2) デリバティブ取引
	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。	同左
	(3) 上記以外の金融商品	(3) 上記以外の金融商品
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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
	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18期 [平成30年1月16日現在]	第19期 [平成30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)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)

株式	198,670,400,699	△56,850,111,068
合計	198,670,400,699	△56,850,111,068

(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

第18期 [平成30年1月16日現在]

区分	種類	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	6,803,560,000	—	7,185,000,000	381,440,000
合計		6,803,560,000	—	7,185,000,000	381,440,000

第19期 [平成30年7月16日現在]

区分	種類	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	7,603,520,000	—	7,684,000,000	80,480,000
合計		7,603,520,000	—	7,684,000,000	80,480,000

(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。

(1口当たり情報)

	第18期 [平成30年1月16日現在]	第19期 [平成30年7月16日現在]
1口当たり純資産額	24,540円	23,183円