

平成 31 年 1 月期（平成 30 年 7 月 17 日～平成 31 年 1 月 16 日）決算短信

平成 31 年 2 月 22 日
上場取引所 東証

ファンド名 MAX I S 日経 2 2 5 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 U F J 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 31 年 4 月 15 日
分配金支払開始予定日 平成 31 年 2 月 22 日

I ファンドの運用状況

1. 平成 31 年 1 月期の運用状況（平成 30 年 7 月 17 日～平成 31 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 31 年 1 月期	1,356,854	(99.8)	3,241	(0.2)	1,360,096	(100.0)
平成 30 年 7 月期	1,410,440	(99.5)	7,626	(0.5)	1,418,067	(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 31 年 1 月期	61,167	15,843	12,136	64,875
平成 30 年 7 月期	56,373	18,197	13,404	61,167

(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 31 年 1 月期	1,479,045	118,949	1,360,096	20,965
平成 30 年 7 月期	1,526,341	108,273	1,418,067	23,183

(4) 分配金

	1 口当たり分配金
	円
平成 31 年 1 月期	196
平成 30 年 7 月期	178

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19期 [平成30年7月16日現在]	第20期 [平成31年1月16日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	113,266,929,278	118,793,468,877
株式	1,410,440,711,280	1,356,854,492,280
派生商品評価勘定	80,296,400	136,766,280
未収入金	81,588,140	-
未収配当金	1,781,090,400	2,321,838,000
前払金	143,700,000	299,960,000
その他未収収益	4,639,336	4,374,702
差入委託証拠金	542,520,000	635,040,000
流動資産合計	1,526,341,474,834	1,479,045,940,139
資産合計	1,526,341,474,834	1,479,045,940,139
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	32,283,220
未払金	-	476,097,840
未払収益分配金	10,887,779,934	12,715,530,184
未払受託者報酬	448,481,790	486,173,304
未払委託者報酬	748,324,385	822,216,884
未払利息	903,528	219,621
受入担保金	95,944,412,256	104,158,766,460
その他未払費用	243,870,990	258,206,884
流動負債合計	108,273,772,883	118,949,494,397
負債合計	108,273,772,883	118,949,494,397
純資産の部		
元本等		
元本	451,231,194,231	478,584,011,058
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	966,836,507,720	881,512,434,684
(分配準備積立金)	28,177,601	62,076,020
元本等合計	1,418,067,701,951	1,360,096,445,742
純資産合計	1,418,067,701,951	1,360,096,445,742
負債純資産合計	1,526,341,474,834	1,479,045,940,139

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第19期		第20期	
	自	平成30年1月17日 至 平成30年7月16日	自	平成30年7月17日 至 平成31年1月16日
営業収益				
受取配当金		12,301,030,572		14,291,200,660
受取利息		17,174		150,683
有価証券売買等損益		△78,253,274,807		△122,651,014,156
派生商品取引等損益		368,468,060		△1,687,421,050
その他収益		26,012,573		63,157,945
営業収益合計		△65,557,746,428		△109,983,925,918
営業費用				
支払利息		19,968,508		37,409,617
受託者報酬		448,481,790		486,173,304
委託者報酬		748,324,385		822,216,884
その他費用		244,104,951		259,280,880
営業費用合計		1,460,879,634		1,605,080,685
営業利益又は営業損失(△)		△67,018,626,062		△111,589,006,603
経常利益又は経常損失(△)		△67,018,626,062		△111,589,006,603
当期純利益又は当期純損失(△)		△67,018,626,062		△111,589,006,603
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(△)		967,534,281,242		966,836,507,720
剰余金増加額又は欠損金減少額		284,891,243,061		236,772,599,934
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		284,891,243,061		236,772,599,934
剰余金減少額又は欠損金増加額		207,682,610,587		197,792,136,183
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		207,682,610,587		197,792,136,183
分配金		10,887,779,934		12,715,530,184
期末剰余金又は期末欠損金(△)		966,836,507,720		881,512,434,684

(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19期 [平成30年7月16日現在]	第20期 [平成31年1月16日現在]
1. 期首元本額	415,870,865,214 円	451,231,194,231 円
期中追加設定元本額	134,241,703,410 円	116,880,686,364 円
期中一部交換元本額	98,881,374,393 円	89,527,869,537 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	99,590,931,040 円
3. 受益権の総数	61,167,303 口	64,875,154 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第19期 自平成30年1月17日 至平成30年7月16日	第20期 自平成30年7月17日 至平成31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。	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>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	<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>14,317,099,671 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>28,177,601 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>14,345,277,272 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>1,567,671,068 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>12,777,606,204 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>12,715,530,184 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>62,076,020 円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>64,875,154 口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金額</td> <td>I=F/H</td> <td>196 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	14,317,099,671 円	分配準備積立金額	B	28,177,601 円	配当等収益合計額	C=A+B	14,345,277,272 円	経費	D	1,567,671,068 円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	12,777,606,204 円	収益分配金金額	F	12,715,530,184 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	62,076,020 円	当ファンドの期末残存口数	H	64,875,154 口	1口当たり分配金額	I=F/H	196 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																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	14,317,099,671 円																																																											
分配準備積立金額	B	28,177,601 円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	14,345,277,272 円																																																											
経費	D	1,567,671,068 円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	12,777,606,204 円																																																											
収益分配金金額	F	12,715,530,184 円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	62,076,020 円																																																											
当ファンドの期末残存口数	H	64,875,154 口																																																											
1口当たり分配金額	I=F/H	196 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19期 自平成30年1月17日 至平成30年7月16日	第20期 自平成30年7月17日 至平成31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。 当ファンドは、運用の効率化を図るた	同左

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

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第19期 [平成30年7月16日現在]	第20期 [平成31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>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 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>	<p>(1) 有価証券</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p>
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19期 [平成30年7月16日現在]	第20期 [平成31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)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	△56,850,111,068	△127,363,589,511
合計	△56,850,111,068	△127,363,589,511

(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

第20期 [平成31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	3,184,660,000	—	3,289,230,000	104,570,000
合計		3,184,660,000	—	3,289,230,000	104,570,000

(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19期 [平成30年7月16日現在]	第20期 [平成31年1月16日現在]
1口当たり純資産額	23,183円	20,965円