

令和1年7月期（平成31年1月17日～令和1年7月16日）決算短信

令和1年8月23日

ファンド名 MAXIS JAPAN 設備・人材積極投資企業200上場投 信 上場取引所 東証
 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 <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 令和1年10月15日
 分配金支払開始予定日 令和1年8月23日

I ファンドの運用状況

1. 令和1年7月期の運用状況（平成31年1月17日～令和1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	%
令和1年7月期	3,775	(99.7)	12	(0.3)	3,787	(100.0)
平成31年1月期	4,083	(99.6)	16	(0.4)	4,100	(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
令和1年7月期	182	—	19	162
平成31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
令和1年7月期	3,833	46	3,787	23,299
平成31年1月期	4,147	47	4,100	22,462

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
令和1年7月期	246
平成31年1月期	218

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5期 [平成31年1月16日現在]	第6期 [令和1年7月16日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	34,016,609	49,326,594
株式	4,083,770,930	3,775,468,750
派生商品評価勘定	-	99,460
未収入金	18,221,070	247,840
未収配当金	9,617,200	7,486,665
前払金	920,000	-
差入委託証拠金	1,110,000	1,350,000
流動資産合計	4,147,655,809	3,833,979,309
資産合計	4,147,655,809	3,833,979,309
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	490,540	-
前受金	-	480,000
未払金	521,080	-
未払収益分配金	39,792,194	39,992,958
未払受託者報酬	981,980	819,180
未払委託者報酬	4,418,838	3,686,215
未払利息	62	107
その他未払費用	1,440,339	1,165,618
流動負債合計	47,645,033	46,144,078
負債合計	47,645,033	46,144,078
純資産の部		
元本等		
元本	3,267,523,233	2,910,219,273
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	832,487,543	877,615,958
(分配準備積立金)	26,411	89,951
元本等合計	4,100,010,776	3,787,835,231
純資産合計	4,100,010,776	3,787,835,231
負債純資産合計	4,147,655,809	3,833,979,309

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期		第6期	
	自	平成30年7月17日 至 平成31年1月16日	自	平成31年1月17日 至 令和1年7月16日
営業収益				
受取配当金		46,592,155		45,708,654
受取利息		24		4
有価証券売買等損益		△620,767,470		142,715,095
派生商品取引等損益		△4,410,320		△83,480
その他収益		81,202		33,055
営業収益合計		△578,504,409		188,373,328
営業費用				
支払利息		9,592		7,868
受託者報酬		981,980		819,180
委託者報酬		4,418,838		3,686,215
その他費用		1,445,986		1,171,952
営業費用合計		6,856,396		5,685,215
営業利益又は営業損失(△)		△585,360,805		182,688,113
経常利益又は経常損失(△)		△585,360,805		182,688,113
当期純利益又は当期純損失(△)		△585,360,805		182,688,113
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(△)		1,457,640,542		832,487,543
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		97,566,740
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		97,566,740
分配金		39,792,194		39,992,958
期末剰余金又は期末欠損金(△)		832,487,543		877,615,958

(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5期 [平成31年1月16日現在]	第6期 [令和1年7月16日現在]
1. 期首元本額	3,267,523,233円	3,267,523,233円
期中追加設定元本額	—円	—円
期中一部交換元本額	—円	357,303,960円
2. 受益権の総数	182,533口	162,573口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自平成30年7月17日 至平成31年1月16日			第6期 自平成31年1月17日 至令和1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		
項目			項目		
当期配当等収益額	A	46,663,789円	当期配当等収益額	A	45,733,845円
分配準備積立金額	B	1,620円	分配準備積立金額	B	26,411円
配当等収益合計額	C=A+B	46,665,409円	配当等収益合計額	C=A+B	45,760,256円
経費	D	6,846,804円	経費	D	5,677,347円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	39,818,605円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	40,082,909円
収益分配金金額	F	39,792,194円	収益分配金金額	F	39,992,958円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	26,411円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	89,951円
当ファンドの期末残存口数	H	182,533口	当ファンドの期末残存口数	H	162,573口
1口当たり分配金額	I=F/H	218円	1口当たり分配金額	I=F/H	246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5期 自平成30年7月17日 至平成31年1月16日	第6期 自平成31年1月17日 至令和1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。 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

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</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5期 [平成31年1月16日現在]	第6期 [令和1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	(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
	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
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5期 [平成31年1月16日現在]	第6期 [令和1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	△554,672,806	139,822,777
合計	△554,672,806	139,822,777

(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5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	15,870,000	—	15,380,000	△490,000
合計		15,870,000	—	15,380,000	△490,000

第6期 [令和1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	15,550,000	—	15,650,000	100,000
合計		15,550,000	—	15,650,000	100,000

(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。

(1口当たり情報)

	第5期 [平成31年1月16日現在]	第6期 [令和1年7月16日現在]
1口当たり純資産額	22,462円	23,299円