

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
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 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	1,387,790	(99.6)	5,826	(0.4)	1,393,616	(100.0)
平成31年1月期	1,356,854	(99.8)	3,241	(0.2)	1,360,096	(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	64,875	8,537	10,316	63,095
平成31年1月期	61,167	15,843	12,136	64,875

(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	1,887,105	493,488	1,393,616	22,087
平成31年1月期	1,479,045	118,949	1,360,096	20,965

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
令和1年7月期	223
平成31年1月期	196

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20期 [平成31年1月16日現在]	第21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	118,793,468,877	496,253,366,985
株式	1,356,854,492,280	1,387,790,336,660
派生商品評価勘定	136,766,280	103,633,660
未収入金	-	242,819,020
未収配当金	2,321,838,000	1,982,330,900
未収利息	-	14,211,225
前払金	299,960,000	-
その他未収収益	4,374,702	78,806,862
差入委託証拠金	635,040,000	639,630,000
流動資産合計	1,479,045,940,139	1,887,105,135,312
資産合計	1,479,045,940,139	1,887,105,135,312
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	32,283,220	-
前受金	-	463,750,000
未払金	476,097,840	-
未払収益分配金	12,715,530,184	14,070,369,644
未払受託者報酬	486,173,304	490,151,301
未払委託者報酬	822,216,884	829,646,839
未払利息	219,621	1,076,665
受入担保金	104,158,766,460	477,391,727,693
その他未払費用	258,206,884	241,800,300
流動負債合計	118,949,494,397	493,488,522,442
負債合計	118,949,494,397	493,488,522,442
純資産の部		
元本等		
元本	478,584,011,058	465,457,923,156
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	881,512,434,684	928,158,689,714
(分配準備積立金)	62,076,020	30,599,896
元本等合計	1,360,096,445,742	1,393,616,612,870
純資産合計	1,360,096,445,742	1,393,616,612,870
負債純資産合計	1,479,045,940,139	1,887,105,135,312

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第20期		第21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		14,291,200,660		15,476,542,320
受取利息		150,683		52,418
有価証券売買等損益		△122,651,014,156		72,480,539,506
派生商品取引等損益		△1,687,421,050		455,180,640
その他収益		63,157,945		142,800,839
営業収益合計		△109,983,925,918		88,555,115,723
営業費用				
支払利息		37,409,617		18,580,427
受託者報酬		486,173,304		490,151,301
委託者報酬		822,216,884		829,646,839
その他費用		259,280,880		242,123,490
営業費用合計		1,605,080,685		1,580,502,057
営業利益又は営業損失(△)		△111,589,006,603		86,974,613,666
経常利益又は経常損失(△)		△111,589,006,603		86,974,613,666
当期純利益又は当期純損失(△)		△111,589,006,603		86,974,613,666
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(△)		966,836,507,720		881,512,434,684
剰余金増加額又は欠損金減少額		236,772,599,934		124,857,537,297
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		236,772,599,934		124,857,537,297
剰余金減少額又は欠損金増加額		197,792,136,183		151,115,526,289
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		197,792,136,183		151,115,526,289
分配金		12,715,530,184		14,070,369,644
期末剰余金又は期末欠損金(△)		881,512,434,684		928,158,689,714

(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20期 [平成31年1月16日現在]	第21期 [令和1年7月16日現在]
1. 期首元本額	451,231,194,231円	478,584,011,058円
期中追加設定元本額	116,880,686,364円	62,979,935,049円
期中一部交換元本額	89,527,869,537円	76,106,022,951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	99,590,931,040円	452,222,354,680円
3. 受益権の総数	64,875,154口	63,095,828口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第20期 自平成30年7月17日 至平成31年1月16日	第21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																																																												
<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	<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>15,600,815,150円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>62,076,020円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>15,662,891,170円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>1,561,921,630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>14,100,969,540円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>14,070,369,644円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>30,599,896円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>63,095,828口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金額</td> <td>I=F/H</td> <td>223円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	15,600,815,150円	分配準備積立金額	B	62,076,020円	配当等収益合計額	C=A+B	15,662,891,170円	経費	D	1,561,921,630円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	14,100,969,540円	収益分配金金額	F	14,070,369,644円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	30,599,896円	当ファンドの期末残存口数	H	63,095,828口	1口当たり分配金額	I=F/H	223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																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	15,600,815,150円																																																											
分配準備積立金額	B	62,076,020円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	15,662,891,170円																																																											
経費	D	1,561,921,630円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	14,100,969,540円																																																											
収益分配金金額	F	14,070,369,644円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	30,599,896円																																																											
当ファンドの期末残存口数	H	63,095,828口																																																											
1口当たり分配金額	I=F/H	223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20期 自平成30年7月17日 至平成31年1月16日	第21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。	同左

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

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第20期 [平成31年1月16日現在]	第21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	<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 同左</p> <p>(2) デリバティブ取引 同左</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 同左</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20期 [平成31年1月16日現在]	第21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	△127,363,589,511	62,541,476,831
合計	△127,363,589,511	62,541,476,831

(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

第21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	5,722,720,000	—	5,826,500,000	103,780,000
合計		5,722,720,000	—	5,826,500,000	103,780,000

(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20期 [平成31年1月16日現在]	第21期 [令和1年7月16日現在]
1口当たり純資産額	20,965円	22,087円