

令和3年10月期（令和3年4月11日～令和3年10月10日）決算短信

令和3年11月16日

ファンド名 MAXIS日本株高配当70マーケットニュートラル上場投信 上場取引所 東証
 コード番号 1499
 連動対象指標 野村日本株高配当70マーケットニュートラル指数
 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 横川 直
 問合せ先責任者 商品ディスクロージャー部 笠間 悦男 TEL (03)6250-4910

有価証券報告書提出予定日 令和4年1月7日
 分配金支払開始予定日 令和3年11月18日

I ファンドの運用状況

1. 令和3年10月期の運用状況（令和3年4月11日～令和3年10月10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3年10月期	5,563	(97.0)	169	(3.0)	5,732	(100.0)
令和3年4月期	4,354	(98.5)	66	(1.5)	4,420	(100.0)

(2) 設定・解約実績

	前特定期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	解約口数(③)	当特定期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
令和3年10月期	560	170	30	700
令和3年4月期	860	—	300	560

(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/当特定期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
令和3年10月期	7,091	1,358	5,732	8,190
令和3年4月期	5,724	1,304	4,420	7,893

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
令和3年10月期	118
令和3年4月期	149

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)

	前期 [令和 3 年 4 月 10 日現在]	当期 [令和 3 年 10 月 10 日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,290,618,999	1,388,261,164
株式	4,354,099,850	5,563,445,890
プット・オプション(買)	370,000	1,960,000
派生商品評価勘定	19,450	67,698,100
未収配当金	79,552,700	70,233,450
流動資産合計	5,724,660,999	7,091,598,604
資産合計	5,724,660,999	7,091,598,604
負債の部		
流動負債		
コール・オプション(売)	1,221,000,000	1,209,320,000
派生商品評価勘定	2,228,700	-
前受金	610,000	77,300,000
未払収益分配金	73,360,000	65,800,000
未払受託者報酬	617,063	536,084
未払委託者報酬	5,553,518	4,824,718
未払利息	396	1,105
その他未払費用	939,859	832,968
流動負債合計	1,304,309,536	1,358,614,875
負債合計	1,304,309,536	1,358,614,875
純資産の部		
元本等		
元本	5,600,000,000	7,000,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△1,179,648,537	△1,267,016,271
(分配準備積立金)	57,970	299,084
元本等合計	4,420,351,463	5,732,983,729
純資産合計	4,420,351,463	5,732,983,729
負債純資産合計	5,724,660,999	7,091,598,604

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期		当期	
	自 令和 2年 10月 11日 至 令和 3年 4月 10日		自 令和 3年 4月 11日 至 令和 3年 10月 10日	
営業収益				
受取配当金		102,102,575		91,921,650
受取利息		1,651		2,192
有価証券売買等損益		1,256,647,896		178,930,602
派生商品取引等損益		△1,061,706,050		△629,450
その他収益		15,805		709
営業収益合計		297,061,877		270,225,703
営業費用				
支払利息		130,505		119,299
受託者報酬		1,308,379		1,035,031
委託者報酬		11,775,335		9,315,263
その他費用		2,060,045		1,733,844
営業費用合計		15,274,264		12,203,437
営業利益又は営業損失(△)		281,787,613		258,022,266
経常利益又は経常損失(△)		281,787,613		258,022,266
当期純利益又は当期純損失(△)		281,787,613		258,022,266
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約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(△)		△1,988,626,150		△1,179,648,537
剰余金増加額又は欠損金減少額		614,770,000		56,660,000
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		614,770,000		56,660,000
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		322,570,000
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		322,570,000
分配金		87,580,000		79,480,000
期末剰余金又は期末欠損金(△)		△1,179,648,537		△1,267,016,271

(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。 オプション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。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌特定期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

	前期 [令和3年4月10日現在]	当期 [令和3年10月10日現在]
1. 期首元本額	8,600,000,000円	5,600,000,000円
期中追加設定元本額	—円	1,700,000,000円
期中一部解約元本額	3,000,000,000円	300,000,000円
2. 差入委託証拠金代用有価証券 先物取引およびオプション取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の通り差入れを行っております。 株式	3,189,989,350円	3,347,510,330円
3. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	1,179,648,537円	1,267,016,271円
4. 受益権の総数	560,000口	700,000口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 令和2年10月11日 至 令和3年4月10日	当期 自 令和3年4月11日 至 令和3年10月10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 第13期 令和2年10月11日 令和3年1月10日	2. 分配金の計算過程 第15期 令和3年4月11日 令和3年7月10日																																																												
<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>21,906,623円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>792,203円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>22,698,826円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>7,997,472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>14,701,354円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>14,220,000円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>481,354円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>790,000口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金額</td> <td>I=F/H</td> <td>18円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	21,906,623円	分配準備積立金額	B	792,203円	配当等収益合計額	C=A+B	22,698,826円	経費	D	7,997,472円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	14,701,354円	収益分配金金額	F	14,220,000円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	481,354円	当ファンドの期末残存口数	H	790,000口	1口当たり分配金額	I=F/H	18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>19,763,939円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>57,970円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>19,821,909円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>5,826,082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>13,995,827円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>13,680,000円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>315,827円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>570,000口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金額</td> <td>I=F/H</td> <td>24円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	19,763,939円	分配準備積立金額	B	57,970円	配当等収益合計額	C=A+B	19,821,909円	経費	D	5,826,082円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	13,995,827円	収益分配金金額	F	13,680,000円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	315,827円	当ファンドの期末残存口数	H	570,000口	1口当たり分配金額	I=F/H	24円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	21,906,623円																																																											
分配準備積立金額	B	792,203円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	22,698,826円																																																											
経費	D	7,997,472円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	14,701,354円																																																											
収益分配金金額	F	14,220,000円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	481,354円																																																											
当ファンドの期末残存口数	H	790,000口																																																											
1口当たり分配金額	I=F/H	18円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	19,763,939円																																																											
分配準備積立金額	B	57,970円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	19,821,909円																																																											
経費	D	5,826,082円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	13,995,827円																																																											
収益分配金金額	F	13,680,000円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	315,827円																																																											
当ファンドの期末残存口数	H	570,000口																																																											
1口当たり分配金額	I=F/H	24円																																																											
第14期 令和3年1月11日 令和3年4月10日	第16期 令和3年7月11日 令和3年10月10日																																																												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>項目</td> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table>	項目			項目			<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>項目</td> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table>	項目			項目																																																		
項目																																																													
項目																																																													
項目																																																													
項目																																																													

当期配当等収益額	A	80,082,903円	当期配当等収益額	A	72,041,313円
分配準備積立金額	B	481,354円	分配準備積立金額	B	315,827円
配当等収益合計額	C=A+B	80,564,257円	配当等収益合計額	C=A+B	72,357,140円
経費	D	7,146,287円	経費	D	6,258,056円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	73,417,970円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	66,099,084円
収益分配金金額	F	73,360,000円	収益分配金金額	F	65,800,000円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	57,970円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	299,084円
当ファンドの期末残存口数	H	560,000口	当ファンドの期末残存口数	H	700,000口
1口当たり分配金額	I=F/H	131円	1口当たり分配金額	I=F/H	94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	前期 自 令和 2 年 10 月 11 日 至 令和 3 年 4 月 10 日	当期 自 令和 3 年 4 月 11 日 至 令和 3 年 10 月 10 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。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数オプション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。 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。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	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。 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。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	前期	当期
----	----	----

	[令和3年4月10日現在]	[令和3年10月10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 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。 (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。 (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。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 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つた場合、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	前期 [令和3年4月10日現在]	当期 [令和3年10月10日現在]
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	305,134,310	117,720,957
合計	305,134,310	117,720,957

(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

前期 [令和3年4月10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				
	売建	683,810,000	—	686,000,000	△2,190,000
	株価指数オプション取引				
	買建	2,405,000,000	—		
	プット	(185,000)	—	370,000	185,000
	売建	2,405,000,000	—		
	コール	(1,109,260,000)	—	1,221,000,000	△111,740,000
	合計	5,493,810,000	—	1,907,370,000	△113,745,000
		(1,109,445,000)	—		

当期 [令和3年10月10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				
	売建	1,208,010,000	—	1,140,280,000	67,730,000
	株価指数オプション取引				
	買建	2,646,000,000	—		
	プット	(196,000)	—	1,960,000	1,764,000
	売建	2,646,000,000	—		
	コール	(1,330,121,000)	—	1,209,320,000	120,801,000
	合計	6,500,010,000	—	2,351,560,000	190,295,000
		(1,330,317,000)	—		

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

- 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。

株価指数オプション取引

- 取引所の発表する清算値段により評価しております。
- オプション取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- ()内は、オプション料です。
- 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)

	前期 [令和3年4月10日現在]	当期 [令和3年10月10日現在]
1口当たり純資産額	7,893円	8,190円