

令和4年1月期（令和3年7月17日～令和4年1月16日）決算短信

令和4年2月22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 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4月15日
 分配金支払開始予定日 令和4年2月24日

I ファンドの運用状況

1. 令和4年1月期の運用状況（令和3年7月17日～令和4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	%
令和4年1月期	1,854,482	(99.2)	15,610	(0.8)	1,870,092	(100.0)
令和3年7月期	1,968,927	(99.6)	8,588	(0.4)	1,977,515	(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4年1月期	68,558	3,056	7,050	64,564
令和3年7月期	64,203	10,364	6,010	68,558

(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4年1月期	2,350,697	480,604	1,870,092	28,965
令和3年7月期	2,669,347	691,831	1,977,515	28,844

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
令和4年1月期	218
令和3年7月期	208

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25期 [令和3年7月16日現在]	第26期 [令和4年1月16日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	696,767,925,043	492,378,109,303
株式	1,968,927,231,480	1,854,482,419,440
未収配当金	1,925,929,500	2,426,824,300
未収利息	9,956,290	2,970,659
前払金	603,517,000	-
その他未収収益	57,843,719	76,579,037
差入委託証拠金	1,055,220,000	1,330,560,000
流動資産合計	2,669,347,623,032	2,350,697,462,739
資産合計	2,669,347,623,032	2,350,697,462,739
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	308,976,400	112,937,250
前受金	-	254,502,000
未払金	505,984,680	58,359,440
未払収益分配金	14,260,093,120	14,075,095,008
未払受託者報酬	692,719,811	693,516,376
未払委託者報酬	1,264,349,099	1,262,135,627
未払利息	728,456	371,508
受入担保金	674,447,533,397	463,796,273,011
その他未払費用	351,339,354	351,590,587
流動負債合計	691,831,724,317	480,604,780,807
負債合計	691,831,724,317	480,604,780,807
純資産の部		
元本等		
元本	505,753,398,780	476,293,467,312
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,471,762,499,935	1,393,799,214,620
(分配準備積立金)	50,420,958	63,778,617
元本等合計	1,977,515,898,715	1,870,092,681,932
純資産合計	1,977,515,898,715	1,870,092,681,932
負債純資産合計	2,669,347,623,032	2,350,697,462,739

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第25期		第26期	
	自 至	令和3年1月17日 令和3年7月16日	自 至	令和3年7月17日 令和4年1月16日
営業収益				
受取配当金		15,887,269,206		16,010,207,600
受取利息		53,625,224		76,538,192
有価証券売買等損益		△34,346,487,784		19,800,189,259
派生商品取引等損益		△744,650,330		△1,564,088,540
その他収益		687,685,947		375,630,520
営業収益合計		△18,462,557,737		34,698,477,031
営業費用				
支払利息		36,807,493		66,420,413
受託者報酬		692,719,811		693,516,376
委託者報酬		1,264,349,099		1,262,135,627
その他費用		351,557,063		351,851,229
営業費用合計		2,345,433,466		2,373,923,645
営業利益又は営業損失(△)		△20,807,991,203		32,324,553,386
経常利益又は経常損失(△)		△20,807,991,203		32,324,553,386
当期純利益又は当期純損失(△)		△20,807,991,203		32,324,553,386
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(△)		1,412,566,293,474		1,471,762,499,935
剰余金増加額又は欠損金減少額		232,562,025,270		67,834,707,769
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		232,562,025,270		67,834,707,769
剰余金減少額又は欠損金増加額		138,297,734,486		164,047,451,462
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		138,297,734,486		164,047,451,462
分配金		14,260,093,120		14,075,095,008
期末剰余金又は期末欠損金(△)		1,471,762,499,935		1,393,799,214,620

(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。

(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計算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)

	第25期 [令和3年7月16日現在]	第26期 [令和4年1月16日現在]
1. 期首元本額	473,632,679,313円	505,753,398,780円
期中追加設定元本額	76,457,241,921円	22,548,538,200円
期中一部交換元本額	44,336,522,454円	52,008,469,668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	628,776,292,460円	434,155,363,620円
3. 受益権の総数	68,558,140口	64,564,656口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第25期 自 令和3年1月17日 至 令和3年7月16日	第26期 自 令和3年7月17日 至 令和4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>16,591,772,884円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>27,367,167円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>16,619,140,051円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>2,308,625,973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>14,310,514,078円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>14,260,093,120円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>50,420,958円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>68,558,140口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金額</td> <td>I=F/H</td> <td>208円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	16,591,772,884円	分配準備積立金額	B	27,367,167円	配当等収益合計額	C=A+B	16,619,140,051円	経費	D	2,308,625,973円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	14,310,514,078円	収益分配金金額	F	14,260,093,120円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	50,420,958円	当ファンドの期末残存口数	H	68,558,140口	1口当たり分配金額	I=F/H	208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>16,395,955,899円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>50,420,958円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>16,446,376,857円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>2,307,503,232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>14,138,873,625円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>14,075,095,008円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>63,778,617円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>64,564,656口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金額</td> <td>I=F/H</td> <td>218円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	16,395,955,899円	分配準備積立金額	B	50,420,958円	配当等収益合計額	C=A+B	16,446,376,857円	経費	D	2,307,503,232円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	14,138,873,625円	収益分配金金額	F	14,075,095,008円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	63,778,617円	当ファンドの期末残存口数	H	64,564,656口	1口当たり分配金額	I=F/H	218円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	16,591,772,884円																																																											
分配準備積立金額	B	27,367,167円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	16,619,140,051円																																																											
経費	D	2,308,625,973円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	14,310,514,078円																																																											
収益分配金金額	F	14,260,093,120円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	50,420,958円																																																											
当ファンドの期末残存口数	H	68,558,140口																																																											
1口当たり分配金額	I=F/H	208円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	16,395,955,899円																																																											
分配準備積立金額	B	50,420,958円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	16,446,376,857円																																																											
経費	D	2,307,503,232円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	14,138,873,625円																																																											
収益分配金金額	F	14,075,095,008円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	63,778,617円																																																											
当ファンドの期末残存口数	H	64,564,656口																																																											
1口当たり分配金額	I=F/H	218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25期 自 令和3年1月17日 至 令和3年7月16日	第26期 自 令和3年7月17日 至 令和4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	同左

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>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。</p> <p>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。</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>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<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25期 [令和3年7月16日現在]	第26期 [令和4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ぬ。	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	第25期	第26期
----	------	------

	[令和3年7月16日現在]	[令和4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	△39,407,738,652	4,944,632,712
合計	△39,407,738,652	4,944,632,712

(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25期 [令和3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	8,911,247,000	—	8,602,440,000	△308,807,000
合計		8,911,247,000	—	8,602,440,000	△308,807,000

第26期 [令和4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	15,758,082,000	—	15,645,450,000	△112,632,000
合計		15,758,082,000	—	15,645,450,000	△112,632,000

(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)

	第25期 自 令和3年1月17日 至 令和3年7月16日	第26期 自 令和3年7月17日 至 令和4年1月16日
	関連当事者の名称	三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社
関係内容	当該投資信託財産の運用の指図を行う投資信託委託会社の利害関係人等	同左
取引の内容	有価証券の貸付 品貸料の受取 利息の受取	同左
取引の種類別取引金額	有価証券の貸付 一円 品貸料の受取 3,498,350円 利息の受取 789,190円	有価証券の貸付 一円 品貸料の受取 3,292,893円 利息の受取 1,263,879円
取引条件及び取引条件の決定方針	社内規定に基づき、有価証券貸借取引契約を締結し、有価証券の貸付を行い、担保金を受入れています。取引条件は市場実勢を勘案して、合理的に決定しております。	同左

取引により発生した債権または債務に係る主な項目別の当該計算期間の末日における残高	受入担保金	5,773,082,490 円	受入担保金	11,959,020,675 円
	その他未収収益	158,832 円	その他未収収益	375,750 円
	未収利息	70,887 円	未収利息	72,319 円

	第25期 自 令和3年1月17日 至 令和3年7月16日		第26期 自 令和3年7月17日 至 令和4年1月16日	
	関連当事者の名称	モルガン・スタンレーMUF G証券株式会社		同左
関係内容	当該投資信託財産の運用の指図を行う投資信託委託会社の利害関係人等		同左	
取引の内容	有価証券の貸付 品貸料の受取 利息の受取		同左	
取引の種類別取引金額	有価証券の貸付	—円	有価証券の貸付	—円
	品貸料の受取	189,215 円	品貸料の受取	1,005,384 円
	利息の受取	13,839 円	利息の受取	131,764 円
取引条件及び取引条件の決定方針	社内規定に基づき、有価証券貸借取引契約を締結し、有価証券の貸付を行い、担保金を受入れております。取引条件は市場実勢を勘案して、合理的に決定しております。		同左	
取引により発生した債権または債務に係る主な項目別の当該計算期間の末日における残高	受入担保金	—円	受入担保金	549,319,092 円
	その他未収収益	—円	その他未収収益	27,006 円
	未収利息	—円	未収利息	3,498 円

(注)有価証券の貸付の取引金額については、取引に伴う洗替を日々行っているものであり、かつ金額が多額であるため記載しておりません。

(1口当たり情報)

	第25期 [令和3年7月16日現在]	第26期 [令和4年1月16日現在]
	1口当たり純資産額	28,844 円