

令和4年7月期（令和4年1月17日～令和4年7月16日）決算短信

令和4年8月24日
上場取引所 東証

ファンド名 MAXIS JPX日経インデックス400上場投信
 コード番号 1593
 連動対象指標 JPX日経インデックス400
 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10月14日
 分配金支払開始予定日 令和4年8月24日

I ファンドの運用状況

1. 令和4年7月期の運用状況（令和4年1月17日～令和4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4年7月期	561,535	(98.7)	7,440	(1.3)	568,976	(100.0)
令和4年1月期	594,358	(98.7)	7,811	(1.3)	602,169	(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7月期	33,055	199	581	32,673
令和4年1月期	32,527	1,398	871	33,055

(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7月期	690,558	121,582	568,976	17,414
令和4年1月期	707,751	105,581	602,169	18,217

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
令和4年7月期	237
令和4年1月期	180

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16期 [令和4年1月16日現在]	第17期 [令和4年7月16日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	111,967,663,537	127,067,338,741
株式	594,358,172,720	561,535,099,500
派生商品評価勘定	29,913,600	419,140
未収入金	11,915,612	-
未収配当金	604,217,950	404,654,643
未収利息	550,287	900,081
前払金	-	460,212,492
その他未収収益	234,353,048	456,405,932
差入委託証拠金	544,612,500	633,746,000
流動資産合計	707,751,399,254	690,558,776,529
資産合計	707,751,399,254	690,558,776,529
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	11,616,370	212,906,072
前受金	232,985,630	-
未払金	-	241,252,978
未払収益分配金	5,950,009,620	7,743,668,322
未払受託者報酬	107,620,783	102,077,690
未払委託者報酬	181,348,460	171,932,118
未払利息	84,481	102,836
受入担保金	98,937,394,937	112,952,481,176
その他未払費用	160,824,044	158,285,503
流動負債合計	105,581,884,325	121,582,706,695
負債合計	105,581,884,325	121,582,706,695
純資産の部		
元本等		
元本	341,497,496,579	337,552,056,686
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	260,672,018,350	231,424,013,148
(分配準備積立金)	19,321,965	18,695,109
元本等合計	602,169,514,929	568,976,069,834
純資産合計	602,169,514,929	568,976,069,834
負債純資産合計	707,751,399,254	690,558,776,529

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第16期		第17期	
	自 至	令和3年7月17日 令和4年1月16日	自 至	令和4年1月17日 令和4年7月16日
営業収益				
受取配当金		5,917,026,924		7,017,920,968
受取利息		18,052,749		10,527,944
有価証券売買等損益		14,387,513,388		△26,008,372,879
派生商品取引等損益		87,318,742		△517,990,616
その他収益		470,947,441		1,156,747,713
営業収益合計		20,880,859,244		△18,341,166,870
営業費用				
支払利息		16,200,316		9,649,546
受託者報酬		107,620,783		102,077,690
委託者報酬		181,348,460		171,932,118
その他費用		161,035,076		158,495,805
営業費用合計		466,204,635		442,155,159
営業利益又は営業損失(△)		20,414,654,609		△18,783,322,029
経常利益又は経常損失(△)		20,414,654,609		△18,783,322,029
当期純利益又は当期純損失(△)		20,414,654,609		△18,783,322,029
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(△)		241,780,134,669		260,672,018,350
剰余金増加額又は欠損金減少額		11,927,098,756		1,441,068,352
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		11,927,098,756		1,441,068,352
剰余金減少額又は欠損金増加額		7,499,860,064		4,162,083,203
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		7,499,860,064		4,162,083,203
分配金		5,950,009,620		7,743,668,322
期末剰余金又は期末欠損金(△)		260,672,018,350		231,424,013,148

(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16期 [令和4年1月16日現在]	第17期 [令和4年7月16日現在]
1. 期首元本額	336,045,507,618円	341,497,496,579円
期中追加設定元本額	14,451,591,667円	2,065,001,604円
期中一部交換元本額	8,999,602,706円	6,010,441,497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	91,542,646,660円	107,813,785,110円
3. 受益権の総数	33,055,609口	32,673,706口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第16期 自 令和3年7月17日 至 令和4年1月16日	第17期 自 令和4年1月17日 至 令和4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>6,389,826,798円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>29,509,106円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>6,419,335,904円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>450,004,319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>5,969,331,585円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>5,950,009,620円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>19,321,965円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>33,055,609口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金額</td> <td>I=F/H</td> <td>180円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	6,389,826,798円	分配準備積立金額	B	29,509,106円	配当等収益合計額	C=A+B	6,419,335,904円	経費	D	450,004,319円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	5,969,331,585円	収益分配金金額	F	5,950,009,620円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	19,321,965円	当ファンドの期末残存口数	H	33,055,609口	1口当たり分配金額	I=F/H	180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>8,175,547,079円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>19,321,965円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>8,194,869,044円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>432,505,613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>7,762,363,431円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>7,743,668,322円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>18,695,109円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>32,673,706口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金額</td> <td>I=F/H</td> <td>237円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	8,175,547,079円	分配準備積立金額	B	19,321,965円	配当等収益合計額	C=A+B	8,194,869,044円	経費	D	432,505,613円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	7,762,363,431円	収益分配金金額	F	7,743,668,322円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	18,695,109円	当ファンドの期末残存口数	H	32,673,706口	1口当たり分配金額	I=F/H	237円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	6,389,826,798円																																																											
分配準備積立金額	B	29,509,106円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	6,419,335,904円																																																											
経費	D	450,004,319円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	5,969,331,585円																																																											
収益分配金金額	F	5,950,009,620円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	19,321,965円																																																											
当ファンドの期末残存口数	H	33,055,609口																																																											
1口当たり分配金額	I=F/H	180円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	8,175,547,079円																																																											
分配準備積立金額	B	19,321,965円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	8,194,869,044円																																																											
経費	D	432,505,613円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	7,762,363,431円																																																											
収益分配金金額	F	7,743,668,322円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	18,695,109円																																																											
当ファンドの期末残存口数	H	32,673,706口																																																											
1口当たり分配金額	I=F/H	237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16期 自 令和3年7月17日 至 令和4年1月16日	第17期 自 令和4年1月17日 至 令和4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	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16期 [令和4年1月16日現在]	第17期 [令和4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</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16期	第17期
----	------	------

	[令和4年1月16日現在]	[令和4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	12,963,122,045	△24,816,006,517
合計	12,963,122,045	△24,816,006,517

(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16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	7,806,277,270	—	7,824,624,000	18,346,730
合計		7,806,277,270	—	7,824,624,000	18,346,730

第17期 [令和4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	7,661,598,492	—	7,449,167,000	△212,431,492
合計		7,661,598,492	—	7,449,167,000	△212,431,492

(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16期 自 令和3年7月17日 至 令和4年1月16日	第17期 自 令和4年1月17日 至 令和4年7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	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 一円 品貸料の受取 8,236,989円 利息の受取 3,000,289円	有価証券の貸付 一円 品貸料の受取 7,342,297円 利息の受取 1,571,811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	24,433,104,832 円	受入担保金	18,222,773,824 円
	その他未収収益	549,088 円	その他未収収益	726,029 円
	未収利息	109,234 円	未収利息	161,042 円

	第16期 自 令和3年7月17日 至 令和4年1月16日	第17期 自 令和4年1月17日 至 令和4年7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 1円 品貸料の受取 1,580,155 円 利息の受取 402,794 円	有価証券の貸付 1円 品貸料の受取 376,121 円 利息の受取 61,674 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 3,788,482,519 円 その他未収収益 214,384 円 未収利息 26,396 円	受入担保金 84,468,825 円 その他未収収益 2,135 円 未収利息 114 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16期 [令和4年1月16日現在]	第17期 [令和4年7月16日現在]
1口当たり純資産額	18,217 円	17,414 円