

令和3年1月期（令和2年7月17日～令和3年1月16日）決算短信

令和3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 松田 通
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3年4月15日
分配金支払開始予定日 令和3年2月24日

I ファンドの運用状況

1. 令和3年1月期の運用状況（令和2年7月17日～令和3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3年1月期	1,876,919	(99.5)	9,279	(0.5)	1,886,198	(100.0)
令和2年7月期	1,407,066	(99.0)	13,662	(1.0)	1,420,728	(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3年1月期	60,651	8,765	5,213	64,203
令和2年7月期	70,941	10,337	20,627	60,651

(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3年1月期	2,461,208	575,009	1,886,198	29,378
令和2年7月期	1,986,426	565,697	1,420,728	23,424

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
令和3年1月期	161
令和2年7月期	211

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23期 [令和2年7月16日現在]	第24期 [令和3年1月16日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	576,224,632,921	579,605,344,439
株式	1,407,066,197,460	1,876,919,082,600
派生商品評価勘定	68,662,150	584,218,150
未収入金	-	766,890,860
未収配当金	1,932,014,150	2,222,331,300
未収利息	7,249,327	4,176,060
その他未収収益	116,025,606	30,174,474
差入委託証拠金	1,011,810,000	1,076,400,000
流動資産合計	1,986,426,591,614	2,461,208,617,883
資産合計	1,986,426,591,614	2,461,208,617,883
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	128,562,150	-
前受金	20,650,000	1,579,248,000
未払金	150,737,620	-
未払収益分配金	12,797,551,322	10,336,839,009
未払受託者報酬	515,879,776	582,419,264
未払委託者報酬	848,802,877	1,001,205,472
未払利息	880,755	299,488
受入担保金	550,977,802,129	561,220,956,537
その他未払費用	257,071,184	288,677,326
流動負債合計	565,697,937,813	575,009,645,096
負債合計	565,697,937,813	575,009,645,096
純資産の部		
元本等		
元本	447,429,081,054	473,632,679,313
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	973,299,572,747	1,412,566,293,474
(分配準備積立金)	46,786,712	27,367,167
元本等合計	1,420,728,653,801	1,886,198,972,787
純資産合計	1,420,728,653,801	1,886,198,972,787
負債純資産合計	1,986,426,591,614	2,461,208,617,883

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第23期		第24期	
	自 至	令和2年1月17日 令和2年7月16日	自 至	令和2年7月17日 令和3年1月16日
営業収益				
受取配当金		12,812,212,609		11,691,507,880
受取利息		2,911,597		75,922,410
有価証券売買等損益		△85,850,045,530		370,940,545,824
派生商品取引等損益		3,333,673,180		3,750,612,750
その他収益		1,602,040,921		491,032,585
営業収益合計		△68,099,207,223		386,949,621,449
営業費用				
支払利息		2,927,012		68,477,706
受託者報酬		515,879,776		582,419,264
委託者報酬		848,802,877		1,001,205,472
その他費用		257,312,343		288,940,969
営業費用合計		1,624,922,008		1,941,043,411
営業利益又は営業損失(△)		△69,724,129,231		385,008,578,038
経常利益又は経常損失(△)		△69,724,129,231		385,008,578,038
当期純利益又は当期純損失(△)		△69,724,129,231		385,008,578,038
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(△)		1,221,028,575,171		973,299,572,747
剰余金増加額又は欠損金減少額		143,015,776,882		159,649,063,609
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		143,015,776,882		159,649,063,609
剰余金減少額又は欠損金増加額		308,223,098,753		95,054,081,911
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		308,223,098,753		95,054,081,911
分配金		12,797,551,322		10,336,839,009
期末剰余金又は期末欠損金(△)		973,299,572,747		1,412,566,293,474

(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23期 [令和2年7月16日現在]	第24期 [令和3年1月16日現在]
1. 期首元本額	523,333,911,084 円	447,429,081,054 円
期中追加設定元本額	76,261,072,737 円	64,663,860,708 円
期中一部交換元本額	152,165,902,767 円	38,460,262,449 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	529,460,459,180 円	534,514,957,900 円
3. 受益権の総数	60,651,902 口	64,203,969 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第23期 自 令和2年1月17日 至 令和2年7月16日			第24期 自 令和2年7月17日 至 令和3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		
項目			項目		
当期配当等収益額	A	14,414,238,115 円	当期配当等収益額	A	12,189,985,169 円
分配準備積立金額	B	52,094,915 円	分配準備積立金額	B	46,786,712 円
配当等収益合計額	C=A+B	14,466,333,030 円	配当等収益合計額	C=A+B	12,236,771,881 円
経費	D	1,621,994,996 円	経費	D	1,872,565,705 円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	12,844,338,034 円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	10,364,206,176 円
収益分配金金額	F	12,797,551,322 円	収益分配金金額	F	10,336,839,009 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	46,786,712 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	27,367,167 円
当ファンドの期末残存口数	H	60,651,902 口	当ファンドの期末残存口数	H	64,203,969 口
1口当たり分配金額	I=F/H	211 円	1口当たり分配金額	I=F/H	161 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23期 自 令和2年1月17日 至 令和2年7月16日	第24期 自 令和2年7月17日 至 令和3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	当ファンドは、株式に投資してありま	同左

<p>係るリスク</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>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> <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23期 [令和2年7月16日現在]	第24期 [令和3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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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>同左</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>同左</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>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23期 [令和2年7月16日現在]	第24期 [令和3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	△39,822,914,054	361,891,529,713
合計	△39,822,914,054	361,891,529,713

(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23期 [令和2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	13,715,570,000	—	13,656,000,000	△59,570,000
	合計	13,715,570,000	—	13,656,000,000	△59,570,000

第24期 [令和3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	8,722,022,000	—	9,306,420,000	584,398,000
	合計	8,722,022,000	—	9,306,420,000	584,398,000

(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はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

	第23期	第24期
	自 令和2年1月17日 至 令和2年7月16日	自 令和2年7月17日 至 令和3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	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 ー円 品貸料の受取 34,796,203円 利息の受取 18,598,076円	有価証券の貸付 ー円 品貸料の受取 12,682,355円 利息の受取 5,053,128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 58,221,497,565円 その他未収収益 2,390,570円 未収利息 970,892円	受入担保金 30,416,299,357円 その他未収収益 1,050,816円 未収利息 237,393円

	第23期 自 令和2年1月17日 至 令和2年7月16日	第24期 自 令和2年7月17日 至 令和3年1月16日
関連当事者の名称	該当事項はありません。	モルガン・スタンレーMUF G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
取引の内容		有価証券の貸付 品貸料の受取 利息の受取
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 1,079,519円 利息の受取 158,857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。
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 1,020,614,700円 その他未収収益 194,691円 未収利息 7,251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23期 [令和2年7月16日現在]	第24期 [令和3年1月16日現在]
1口当たり純資産額	23,424円	29,378円