

2024年1月期（2023年7月17日～2024年1月16日）決算短信

2024年2月22日

ファンド名 MAXIS JAPAN 設備・人材積極投資企業200上場投信 上場取引所 東証
 コード番号 1485
 連動対象指標 iSTOXX MUTB Japan 積極投資企業200インデックス
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 三菱UFJアセットマネジメント株式会社 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)4223-3038

有価証券報告書提出予定日 2024年4月15日
 分配金支払開始予定日 2024年2月22日

I ファンドの運用状況

1. 2024年1月期の運用状況（2023年7月17日～2024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	%
2024年1月期	5,476	(99.1)	51	(0.9)	5,528	(100.0)
2023年7月期	4,895	(98.6)	67	(1.4)	4,963	(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
2024年1月期	143	—	—	143
2023年7月期	143	—	—	143

(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
2024年1月期	5,584	55	5,528	38,420
2023年7月期	5,017	54	4,963	34,489

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
2024年1月期	292
2023年7月期	322

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14期 [2023年7月16日現在]	第15期 [2024年1月16日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	83,430,649	68,048,143
株式	4,895,601,420	5,476,908,010
派生商品評価勘定	661,350	3,400,900
未収入金	23,905,631	20,802,623
未収配当金	10,338,395	11,508,550
差入委託証拠金	3,600,000	3,917,540
流動資産合計	5,017,537,445	5,584,585,766
資産合計	5,017,537,445	5,584,585,766
負債の部		
流動負債		
前受金	1,124,000	5,958,000
未払収益分配金	46,337,088	42,019,968
未払受託者報酬	1,015,223	1,131,014
未払委託者報酬	4,568,461	5,089,505
未払利息	160	36
その他未払費用	1,392,897	1,532,001
流動負債合計	54,437,829	55,730,524
負債合計	54,437,829	55,730,524
純資産の部		
元本等		
元本	2,576,025,504	2,576,025,504
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	2,387,074,112	2,952,829,738
(分配準備積立金)	37,171	67,530
元本等合計	4,963,099,616	5,528,855,242
純資産合計	4,963,099,616	5,528,855,242
負債純資産合計	5,017,537,445	5,584,585,766

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第14期		第15期	
	自	2023年1月17日	自	2023年7月17日
	至	2023年7月16日	至	2024年1月16日
営業収益				
受取配当金		53,274,104		49,818,861
受取利息		270		239
有価証券売買等損益		790,679,142		556,820,417
派生商品取引等損益		14,101,200		8,904,850
その他収益		91		111
営業収益合計		858,054,807		615,544,478
営業費用				
支払利息		11,305		14,005
受託者報酬		1,015,223		1,131,014
委託者報酬		4,568,461		5,089,505
その他費用		1,395,826		1,534,360
営業費用合計		6,990,815		7,768,884
営業利益又は営業損失(△)		851,063,992		607,775,594
経常利益又は経常損失(△)		851,063,992		607,775,594
当期純利益又は当期純損失(△)		851,063,992		607,775,594
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(△)		1,582,347,208		2,387,074,112
分配金		46,337,088		42,019,968
期末剰余金又は期末欠損金(△)		2,387,074,112		2,952,829,738

(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14期 [2023年7月16日現在]	第15期 [2024年1月16日現在]
1. 期首元本額	2,576,025,504円	2,576,025,504円
期中追加設定元本額	—円	—円
期中一部交換元本額	—円	—円
2. 受益権の総数	143,904口	143,904口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第14期 自2023年1月17日 至2023年7月16日	第15期 自2023年7月17日 至2024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。 2. 分配金の計算過程	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																																																												
<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>53,263,160円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>90,609円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>53,353,769円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>6,979,510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>46,374,259円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>46,337,088円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>37,171円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>143,904口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金額</td> <td>I=F/H</td> <td>322円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	53,263,160円	分配準備積立金額	B	90,609円	配当等収益合計額	C=A+B	53,353,769円	経費	D	6,979,510円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	46,374,259円	収益分配金金額	F	46,337,088円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	37,171円	当ファンドの期末残存口数	H	143,904口	1口当たり分配金額	I=F/H	322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>49,805,206円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>37,171円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>49,842,377円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>7,754,879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>42,087,498円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>42,019,968円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>67,530円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>143,904口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金額</td> <td>I=F/H</td> <td>292円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	49,805,206円	分配準備積立金額	B	37,171円	配当等収益合計額	C=A+B	49,842,377円	経費	D	7,754,879円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	42,087,498円	収益分配金金額	F	42,019,968円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	67,530円	当ファンドの期末残存口数	H	143,904口	1口当たり分配金額	I=F/H	292円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	53,263,160円																																																											
分配準備積立金額	B	90,609円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	53,353,769円																																																											
経費	D	6,979,510円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	46,374,259円																																																											
収益分配金金額	F	46,337,088円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	37,171円																																																											
当ファンドの期末残存口数	H	143,904口																																																											
1口当たり分配金額	I=F/H	322円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	49,805,206円																																																											
分配準備積立金額	B	37,171円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	49,842,377円																																																											
経費	D	7,754,879円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	42,087,498円																																																											
収益分配金金額	F	42,019,968円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	67,530円																																																											
当ファンドの期末残存口数	H	143,904口																																																											
1口当たり分配金額	I=F/H	292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14期 自2023年1月17日 至2023年7月16日	第15期 自2023年7月17日 至2024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係るリスク	当ファンドは、株式に投資していません。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	同左

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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、この結果はリスク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14期 [2023年7月16日現在]	第15期 [2024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</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14期 [2023年7月16日現在]	第15期 [2024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	632,537,738	523,277,877
合計	632,537,738	523,277,877

(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14期 [2023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	66,402,000	—	67,065,000	663,000
合計		66,402,000	—	67,065,000	663,000

第15期 [2024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	46,758,000	—	50,160,000	3,402,000
合計		46,758,000	—	50,160,000	3,402,000

(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14期 [2023年7月16日現在]	第15期 [2024年1月16日現在]
1口当たり純資産額	34,489円	38,420円