

令和4年4月期（令和3年10月11日～令和4年4月10日）決算短信

令和4年5月18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7月8日
 分配金支払開始予定日 令和4年5月19日

I ファンドの運用状況

1. 令和4年4月期の運用状況（令和3年10月11日～令和4年4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4年4月期	6,287	(95.3)	307	(4.7)	6,595	(100.0)
令和3年10月期	5,563	(97.0)	169	(3.0)	5,732	(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4年4月期	700	70	10	760
令和3年10月期	560	170	30	700

(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4年4月期	8,102	1,507	6,595	8,678
令和3年10月期	7,091	1,358	5,732	8,190

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
令和4年4月期	143
令和3年10月期	118

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10月10日現在]	当期 [令和4年4月10日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,388,261,164	1,663,737,609
株式	5,563,445,890	6,287,776,190
プット・オプション(買)	1,960,000	1,356,000
派生商品評価勘定	67,698,100	11,040,650
未収配当金	70,233,450	97,489,726
前払金	-	41,140,000
流動資産合計	7,091,598,604	8,102,540,175
資産合計	7,091,598,604	8,102,540,175
負債の部		
流動負債		
コール・オプション(売)	1,209,320,000	1,353,740,000
派生商品評価勘定	-	55,778,700
前受金	77,300,000	-
未払収益分配金	65,800,000	89,680,000
未払受託者報酬	536,084	678,719
未払委託者報酬	4,824,718	6,108,444
未払利息	1,105	540
その他未払費用	832,968	1,017,839
流動負債合計	1,358,614,875	1,507,004,242
負債合計	1,358,614,875	1,507,004,242
純資産の部		
元本等		
元本	7,000,000,000	7,600,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△1,267,016,271	△1,004,464,067
(分配準備積立金)	299,084	661,583
元本等合計	5,732,983,729	6,595,535,933
純資産合計	5,732,983,729	6,595,535,933
負債純資産合計	7,091,598,604	8,102,540,175

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期		当期	
	自 至	令和3年4月11日 令和3年10月10日	自 至	令和3年10月11日 令和4年4月10日
営業収益				
受取配当金		91,921,650		123,524,426
受取利息		2,192		1,573
有価証券売買等損益		178,930,602		287,867,355
派生商品取引等損益		△629,450		55,492,350
その他収益		709		297
営業収益合計		270,225,703		466,886,001
営業費用				
支払利息		119,299		134,188
受託者報酬		1,035,031		1,321,777
委託者報酬		9,315,263		11,895,919
その他費用		1,733,844		2,131,913
営業費用合計		12,203,437		15,483,797
営業利益又は営業損失(△)		258,022,266		451,402,204
経常利益又は経常損失(△)		258,022,266		451,402,204
当期純利益又は当期純損失(△)		258,022,266		451,402,204
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(△)		△1,179,648,537		△1,267,016,271
剰余金増加額又は欠損金減少額		56,660,000		14,420,000
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		56,660,000		14,420,000
剰余金減少額又は欠損金増加額		322,570,000		95,590,000
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		95,590,000
分配金		79,480,000		107,680,000
期末剰余金又は期末欠損金(△)		△1,267,016,271		△1,004,464,067

（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10月10日現在]	当期 [令和4年4月10日現在]
1. 期首元本額	5,600,000,000円	7,000,000,000円
期中追加設定元本額	1,700,000,000円	700,000,000円
期中一部解約元本額	300,000,000円	100,000,000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	3,347,510,330円	2,954,585,780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。	1,267,016,271円	1,004,464,067円
4. 受益権の総数	700,000口	760,000口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期 自 令和3年4月11日 至 令和3年10月10日	当期 自 令和3年10月11日 至 令和4年4月10日																																																																								
<p>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。</p> <p>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</p> <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> <p>第16期 令和3年7月11日 令和3年10月10日</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td></td> <td></td> <td></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						<p>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。</p> <p>2. 分配金の計算過程 第17期 令和3年10月11日 令和4年1月10日</p> <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>25,584,951円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>299,084円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>25,884,035円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>7,475,024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>18,409,011円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>18,000,000円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>409,011円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>720,000口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金額</td> <td>I=F/H</td> <td>25円</td> </tr> </tbody> </table> <p>第18期 令和4年1月11日 令和4年4月10日</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	25,584,951円	分配準備積立金額	B	299,084円	配当等収益合計額	C=A+B	25,884,035円	経費	D	7,475,024円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	18,409,011円	収益分配金金額	F	18,000,000円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	409,011円	当ファンドの期末残存口数	H	720,000口	1口当たり分配金額	I=F/H	25円	項目					
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																																																																									
項目																																																																									
当期配当等収益額	A	25,584,951円																																																																							
分配準備積立金額	B	299,084円																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	25,884,035円																																																																							
経費	D	7,475,024円																																																																							
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	18,409,011円																																																																							
収益分配金金額	F	18,000,000円																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	409,011円																																																																							
当ファンドの期末残存口数	H	720,000口																																																																							
1口当たり分配金額	I=F/H	25円																																																																							
項目																																																																									

当期配当等収益額	A	72,041,313円	当期配当等収益額	A	97,807,157円
分配準備積立金額	B	315,827円	分配準備積立金額	B	409,011円
配当等収益合計額	C=A+B	72,357,140円	配当等収益合計額	C=A+B	98,216,168円
経費	D	6,258,056円	経費	D	7,874,585円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	66,099,084円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	90,341,583円
収益分配金金額	F	65,800,000円	収益分配金金額	F	89,680,000円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	299,084円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	661,583円
当ファンドの期末残存口数	H	700,000口	当ファンドの期末残存口数	H	760,000口
1口当たり分配金額	I=F/H	94円	1口当たり分配金額	I=F/H	118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3年4月11日 至 令和3年10月10日	当期 自 令和3年10月11日 至 令和4年4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10月10日現在]	[令和4年4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10月10日現在]	当期 [令和4年4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	117,720,957	37,016,763
合計	117,720,957	37,016,763

(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	—	1,960,000	1,764,000
	プット	(196,000)	—	1,960,000	1,764,000
	売建	2,646,000,000	—	1,209,320,000	120,801,000
	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
	合計	(1,330,317,000)	—	2,351,560,000	190,295,000

当期 [令和4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	923,270,000	—	967,980,000	△44,710,000
	株価指数オプション取引				
	買建	2,938,000,000			
	プット	(226,000)	—	1,356,000	1,130,000
	売建	2,938,000,000			
	コール	(979,936,000)	—	1,353,740,000	△373,804,000
	合計	6,799,270,000	—	2,323,076,000	△417,384,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

- 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。

株価指数オプション取引

- 1 取引所の発表する清算値段により評価しております。
- 2 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。
- 3 () 内は、オプション料です。
- 4 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10月10日現在]	当期 [令和4年4月10日現在]
1口当たり純資産額	8,190円	8,678円