

平成28年1月期（平成27年7月17日～平成28年1月16日）決算短信

平成28年2月22日

ファンド名 MAXISトピックスリスクコントロール（5%）上場投 上場取引所 東証
信
コード番号 1567
連動対象指標 S&P/JPX リスク・コントロール指数（5%）
主要投資資産 投資信託証券
売買単位 10口
管理会社 三菱UFJ国際投信株式会社 URL <http://www.am.mufg.jp/>
代表者名 取締役社長 金上 孝
問合せ先責任者 ディスクロージャー部 宇野 誠朗 TEL (03)6250-4910

有価証券報告書提出予定日 平成28年 4月15日
分配金支払開始予定日 平成28年 2月24日

I ファンドの運用状況

1. 平成28年1月期の運用状況（平成27年7月17日～平成28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	%
平成28年1月期	11	(99.8)	—	(0.2)	11	(100.0)
平成27年7月期	291	(100.0)	—	(0.0)	291	(100.0)

(2) 設定・解約実績

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	解約口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
平成28年1月期	240	—	230	10
平成27年7月期	300	—	60	240

(3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	100口当たり基準価額 (③/当計算期間末発行済口数)×100
	百万円	百万円	百万円	円
平成28年1月期	11	—	11	115,395
平成27年7月期	292	1	291	121,386

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
平成28年1月期	—
平成27年7月期	21

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

【MAX I S トピックスリスクコントロール (5%) 上場投信】

(1) 【貸借対照表】

	第 7 期	第 8 期
	[平成27年7月16日現在]	[平成28年1月16日現在]
	金額 (円)	金額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,073,950	58,749
投資信託受益証券	291,285,097	11,514,438
未収利息	1	—
流動資産合計	292,359,048	11,573,187
資産合計	292,359,048	11,573,187
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	504,000	—
未払受託者報酬	57,111	2,145
未払委託者報酬	342,640	12,981
その他未払費用	129,264	18,513
流動負債合計	1,033,015	33,639
負債合計	1,033,015	33,639
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	240,000,000	10,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	51,326,033	1,539,548
(分配準備積立金)	(20,741)	(△13,600)
元本等合計	291,326,033	11,539,548
純資産合計	291,326,033	11,539,548
負債純資産合計	292,359,048	11,573,187

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第 7 期	第 8 期
	自 平成27年 1月17日 至 平成27年 7月16日	自 平成27年 7月17日 至 平成28年 1月16日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	1,046,598	4,972
受取利息	216	15
有価証券売買等損益	17,709,807	△564,344
営業収益合計	18,756,621	△559,357
営業費用		
受託者報酬	57,111	2,145
委託者報酬	342,640	12,981
その他費用 ※1	135,419	24,202
営業費用合計	535,170	39,328
営業利益又は営業損失 (△)	18,221,451	△598,685
経常利益又は経常損失 (△)	18,221,451	△598,685
当期純利益又は当期純損失 (△)	18,221,451	△598,685
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 (△)	45,276,182	51,326,033
剰余金減少額又は欠損金増加額	11,667,600	49,187,800
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損 金増加額	11,667,600	49,187,800
分配金 ※2	504,000	—
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	51,326,033	1,539,548

(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	投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
-------------------	--

(貸借対照表に関する注記)

	第7期 [平成27年7月16日現在]	第8期 [平成28年1月16日現在]
※1 期首元本額	300,000,000円	240,000,000円
期中追加設定元本額	—	—
期中一部解約元本額	60,000,000円	230,000,000円
2 受益権の総数	240,000口	10,000口
3 1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	1,213.86円 (121,386円)	1,153.95円 (115,395円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第7期（自平成27年1月17日 至平成27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。

※2 分配金の計算過程

当期配当等収益額	A	1,046,814円
分配準備積立金額	B	13,097円
配当等収益合計額	C=A+B	1,059,911円
経費	D	535,170円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	524,741円
収益分配金金額	F	504,000円
次期繰越金（分配準備積立金）	G=E-F	20,741円
当ファンドの期末残存口数	H	240,000口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	210円

第8期（自平成27年7月17日 至平成28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

当期配当等収益額	A	4,987円
分配準備積立金額	B	20,741円
配当等収益合計額	C=A+B	25,728円
経費	D	39,328円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	—
収益分配金金額	F	—
次期繰越金（分配準備積立金）	G=E-F	△13,600円
当ファンドの期末残存口数	H	10,000口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	—

(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7期 (自平成27年1月17日 至平成27年7月16日)	第8期 (自平成27年7月17日 至平成28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、投資信託受益証券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。 投資信託受益証券は、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。	同 左 同 左

区 分	第 7 期 (自平成27年 1月17日 至平成27年 7月16日)	第 8 期 (自平成27年 7月17日 至平成28年 1月16日)
3 金融商品に係るリスク 管理体制	また、投資信託受益証券に係る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
	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、運用部門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	第 7 期 [平成27年7月16日現在]	第 8 期 [平成28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	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。	同 左
	デリバティブ取引は、該当事項はありません。 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。	同 左 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 7 期 [平成27年7月16日現在]	第 8 期 [平成28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)	
投資信託受益証券	15,193,212	△563,192
合計	15,193,212	△563,192

(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

該当事項はありません。

(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。