

平成29年1月期（平成28年7月17日～平成29年1月16日）決算短信

平成29年2月20日

ファンド名 MAXIS JAPAN クオリティ150 上場投信 上場取引所 東証
 コード番号 1460
 連動対象指標 iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150 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国際投信株式会社 URL <http://www.am.mufg.jp/>
 代表者名 取締役社長 松田 通
 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29年 4月14日
 分配金支払開始予定日 平成29年 2月24日

I ファンドの運用状況

1. 平成29年1月期の運用状況（平成28年7月17日～平成29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29年1月期	780	(98.5)	11	(1.5)	792	(100.0)
平成28年7月期	1,110	(98.4)	18	(1.6)	1,128	(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
平成29年1月期	77	—	29	47
平成28年7月期	—	77	—	77

(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
平成29年1月期	799	7	792	16,551
平成28年7月期	1,141	12	1,128	14,573

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
平成29年1月期	107
平成28年7月期	143

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

【MAXIS JAPANクオリティ150上場投信】

(1) 【貸借対照表】

	第1期	第2期
	[平成28年7月16日現在]	[平成29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	27,904,025	16,510,863
株式	1,110,508,220	780,487,550
派生商品評価勘定	76,460	664,460
未収入金	920	—
未収配当金	1,584,600	1,326,300
前払金	56,000	—
差入委託証拠金	1,140,000	660,000
流動資産合計	1,141,270,225	799,649,173
資産合計	1,141,270,225	799,649,173
負債の部		
流動負債		
前受金	—	825,000
未払収益分配金	11,075,779	5,121,555
未払受託者報酬	164,270	165,206
未払委託者報酬	821,305	825,967
未払利息	68	23
その他未払費用	459,390	508,047
流動負債合計	12,520,812	7,445,798
負債合計	12,520,812	7,445,798
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	1,157,147,820	715,103,100
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) ※2	△28,398,407	77,100,275
(分配準備積立金)	(57,299)	(25,552)
元本等合計	1,128,749,413	792,203,375
純資産合計	1,128,749,413	792,203,375
負債純資産合計	1,141,270,225	799,649,173

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第1期	第2期
	自平成28年3月16日 至平成28年7月16日	自平成28年7月17日 至平成29年1月16日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	12,567,039	6,578,167
受取利息	32	70
有価証券売買等損益	△28,015,278	93,598,529
派生商品取引等損益	△440,428	2,187,840
その他収益	13,573	17,515
営業収益合計	△15,875,062	102,382,121
営業費用		
支払利息	2,585	3,787
受託者報酬	164,270	165,206
委託者報酬	821,305	825,967
その他費用 ※1	459,406	510,984
営業費用合計	1,447,566	1,505,944
営業利益又は営業損失(△)	△17,322,628	100,876,177
経常利益又は経常損失(△)	△17,322,628	100,876,177
当期純利益又は当期純損失(△)	△17,322,628	100,876,177
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(△)	—	△28,398,407
剰余金増加額又は欠損金減少額	—	9,744,060
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損 金減少額	—	9,744,060
分配金 ※2	11,075,779	5,121,555
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△28,398,407	77,100,275

(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1期 [平成28年7月16日現在]	第2期 [平成29年1月16日現在]
※1 期首元本額	—	1,157,147,820円
期中追加設定元本額	1,157,147,820円	—
期中一部交換元本額	—	442,044,720円
※2 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。	28,398,407円	—
3 受益権の総数	77,453口	47,865口
4 1口当たり純資産額	14,573円	16,551円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期(自平成28年3月16日 至 平成28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	12,578,059円
分配準備積立金額	B	—
配当等収益合計額	C=A+B	12,578,059円
経費	D	1,444,981円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	11,133,078円
収益分配金金額	F	11,075,779円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	57,299円
当ファンドの期末残存口数	H	77,453口
1口当たり分配金額	I=F/H	143円

第2期(自平成28年7月17日 至 平成29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	6,591,965円
分配準備積立金額	B	57,299円
配当等収益合計額	C=A+B	6,649,264円
経費	D	1,502,157円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	5,147,107円
収益分配金金額	F	5,121,555円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	25,552円
当ファンドの期末残存口数	H	47,865口
1口当たり分配金額	I=F/H	107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 1 期 (自平成28年 3月16日 至平成28年 7月16日)	第 2 期 (自平成28年 7月17日 至平成29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。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	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。 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 1 期 [平成28年7月16日現在]	第 2 期 [平成29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。 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。 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 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 1 期 [平成28年7月16日現在]	第 2 期 [平成29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	△2,263,128	62,705,895
合計	△2,263,128	62,705,895

(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

区 分	種 類	第 1 期 [平成28年7月16日現在]			
		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	13,163,000	—	13,240,000	77,000
	合 計	13,163,000	—	13,240,000	77,000

区 分	種 類	第 2 期 [平成29年1月16日現在]			
		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	14,610,000	—	15,275,000	665,000
	合 計	14,610,000	—	15,275,000	665,000

(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。