

# 令和2年7月期（令和2年1月17日～令和2年7月16日）決算短信

令和2年8月21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2年10月15日  
分配金支払開始予定日 令和2年8月24日

## I ファンドの運用状況

### 1. 令和2年7月期の運用状況（令和2年1月17日～令和2年7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2年7月期	1,407,066	(99.0)	13,662	(1.0)	1,420,728	(100.0)
令和2年1月期	1,738,027	(99.6)	6,334	(0.4)	1,744,362	(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2年7月期	70,941	10,337	20,627	60,651
令和2年1月期	63,095	15,511	7,666	70,941

(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2年7月期	1,986,426	565,697	1,420,728	23,424
令和2年1月期	2,261,293	516,930	1,744,362	24,589

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
令和2年7月期	211
令和2年1月期	175

### 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22期 [ 令和2年1月16日現在 ]	第23期 [ 令和2年7月16日現在 ]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	519,738,489,840	576,224,632,921
株式	1,738,027,863,840	1,407,066,197,460
派生商品評価勘定	100,088,850	68,662,150
未収入金	270,528,480	-
未収配当金	2,523,917,000	1,932,014,150
未収利息	11,356,600	7,249,327
その他未収収益	56,578,282	116,025,606
差入委託証拠金	564,480,000	1,011,810,000
流動資産合計	2,261,293,302,892	1,986,426,591,614
資産合計	2,261,293,302,892	1,986,426,591,614
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	128,562,150
前受金	363,741,250	20,650,000
未払金	-	150,737,620
未払収益分配金	12,414,726,100	12,797,551,322
未払受託者報酬	521,647,224	515,879,776
未払委託者報酬	880,681,224	848,802,877
未払利息	490,547	880,755
受入担保金	502,499,991,618	550,977,802,129
その他未払費用	249,538,674	257,071,184
流動負債合計	516,930,816,637	565,697,937,813
負債合計	516,930,816,637	565,697,937,813
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	523,333,911,084	447,429,081,054
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,221,028,575,171	973,299,572,747
(分配準備積立金)	52,094,915	46,786,712
元本等合計	1,744,362,486,255	1,420,728,653,801
純資産合計	1,744,362,486,255	1,420,728,653,801
負債純資産合計	2,261,293,302,892	1,986,426,591,614

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第22期		第23期	
	自 至	令和1年7月17日 令和2年1月16日	自 至	令和2年1月17日 令和2年7月16日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		13,419,458,605		12,812,212,609
受取利息		1,472,244		2,911,597
有価証券売買等損益		152,571,916,972		△85,850,045,530
派生商品取引等損益		1,418,000,690		3,333,673,180
その他収益		675,054,782		1,602,040,921
<b>営業収益合計</b>		<b>168,085,903,293</b>		<b>△68,099,207,223</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		7,609,669		2,927,012
受託者報酬		521,647,224		515,879,776
委託者報酬		880,681,224		848,802,877
その他費用		249,826,395		257,312,343
<b>営業費用合計</b>		<b>1,659,764,512</b>		<b>1,624,922,008</b>
営業利益又は営業損失(△)		166,426,138,781		△69,724,129,231
経常利益又は経常損失(△)		166,426,138,781		△69,724,129,231
当期純利益又は当期純損失(△)		166,426,138,781		△69,724,129,231
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(△)		928,158,689,714		1,221,028,575,171
剰余金増加額又は欠損金減少額		259,169,718,833		143,015,776,882
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		259,169,718,833		143,015,776,882
剰余金減少額又は欠損金増加額		120,311,246,057		308,223,098,753
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		120,311,246,057		308,223,098,753
分配金		12,414,726,100		12,797,551,322
期末剰余金又は期末欠損金(△)		1,221,028,575,171		973,299,572,747

(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22期 [令和2年1月16日現在]	第23期 [令和2年7月16日現在]
1. 期首元本額	465,457,923,156円	523,333,911,084円
期中追加設定元本額	114,429,980,571円	76,261,072,737円
期中一部交換元本額	56,553,992,643円	152,165,902,767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	475,996,338,370円	529,460,459,180円
3. 受益権の総数	70,941,292口	60,651,902口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第22期 自 令和1年7月17日 至 令和2年1月16日			第23期 自 令和2年1月17日 至 令和2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。			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																																																														
<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>14,088,375,962円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>30,599,896円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>14,118,975,858円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>1,652,154,843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>12,466,821,015円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>12,414,726,100円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>52,094,915円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>70,941,292口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金額</td> <td>I=F/H</td> <td>175円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	14,088,375,962円	分配準備積立金額	B	30,599,896円	配当等収益合計額	C=A+B	14,118,975,858円	経費	D	1,652,154,843円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	12,466,821,015円	収益分配金金額	F	12,414,726,100円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	52,094,915円	当ファンドの期末残存口数	H	70,941,292口	1口当たり分配金額	I=F/H	175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>14,414,238,115円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>52,094,915円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>14,466,333,030円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>1,621,994,996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>12,844,338,034円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>12,797,551,322円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>46,786,712円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>60,651,902口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金額</td> <td>I=F/H</td> <td>211円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	14,414,238,115円	分配準備積立金額	B	52,094,915円	配当等収益合計額	C=A+B	14,466,333,030円	経費	D	1,621,994,996円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	12,844,338,034円	収益分配金金額	F	12,797,551,322円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	46,786,712円	当ファンドの期末残存口数	H	60,651,902口	1口当たり分配金額	I=F/H	211円		
項目																																																																	
当期配当等収益額	A	14,088,375,962円																																																															
分配準備積立金額	B	30,599,896円																																																															
配当等収益合計額	C=A+B	14,118,975,858円																																																															
経費	D	1,652,154,843円																																																															
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	12,466,821,015円																																																															
収益分配金金額	F	12,414,726,100円																																																															
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	52,094,915円																																																															
当ファンドの期末残存口数	H	70,941,292口																																																															
1口当たり分配金額	I=F/H	175円																																																															
項目																																																																	
当期配当等収益額	A	14,414,238,115円																																																															
分配準備積立金額	B	52,094,915円																																																															
配当等収益合計額	C=A+B	14,466,333,030円																																																															
経費	D	1,621,994,996円																																																															
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	12,844,338,034円																																																															
収益分配金金額	F	12,797,551,322円																																																															
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	46,786,712円																																																															
当ファンドの期末残存口数	H	60,651,902口																																																															
1口当たり分配金額	I=F/H	211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22期 自 令和1年7月17日 至 令和2年1月16日	第23期 自 令和2年1月17日 至 令和2年7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	同左

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>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22期 [令和2年1月16日現在]	第23期 [令和2年7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22期 [令和2年1月16日現在]	第23期 [令和2年7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	145,922,899,305	△39,822,914,054
合計	145,922,899,305	△39,822,914,054

(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22期 [令和2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	6,315,683,750	—	6,415,920,000	100,236,250
合計		6,315,683,750	—	6,415,920,000	100,236,250

## 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

(注) 時価の算定方法

- 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。
- 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 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)

	第22期 自 令和1年7月17日 至 令和2年1月16日		第23期 自 令和2年1月17日 至 令和2年7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 利息の支払		同左	
取引の種類別取引金額	有価証券の貸付	—円	有価証券の貸付	—円
	品貸料の受取	15,746,005円	品貸料の受取	34,796,203円
	利息の支払	8,530,291円	利息の支払	18,598,076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、担保金を受入れています。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	52,096,098,326円	受入担保金	58,221,497,565円
	その他未収収益	2,062,566円	その他未収収益	2,390,570円
	未払利息	1,351,524円	未払利息	970,892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22期 [令和2年1月16日現在]	第23期 [令和2年7月16日現在]
1口当たり純資産額	24,589円	23,424円