

# 令和3年1月期（令和2年7月17日～令和3年1月16日）決算短信

令和3年2月22日  
上場取引所 東証

ファンド名 MAXIS JPX日経インデックス400上場投信  
 コード番号 1593  
 連動対象指標 JPX日経インデックス400  
 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3年4月15日  
 分配金支払開始予定日 令和3年2月24日

## I ファンドの運用状況

### 1. 令和3年1月期の運用状況（令和2年7月17日～令和3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	%
令和3年1月期	530,469	(98.5)	7,853	(1.5)	538,323	(100.0)
令和2年7月期	417,554	(98.6)	5,716	(1.4)	423,270	(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3年1月期	29,104	2,605	490	31,219
令和2年7月期	27,632	3,607	2,136	29,104

(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3年1月期	721,663	183,340	538,323	17,243
令和2年7月期	568,961	145,690	423,270	14,543

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
令和3年1月期	139
令和2年7月期	171

### 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13期 [ 令和2年7月16日現在 ]	第14期 [ 令和3年1月16日現在 ]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	150,142,958,819	189,258,950,383
株式	417,554,161,230	530,469,818,330
派生商品評価勘定	1,381,100	398,375,370
未収入金	-	229,050,668
未収配当金	522,504,828	498,560,475
未収利息	1,706,975	1,174,520
前払金	178,803,550	-
その他未収収益	191,025,769	217,149,067
差入委託証拠金	368,627,000	590,630,500
流動資産合計	568,961,169,271	721,663,709,313
資産合計	568,961,169,271	721,663,709,313
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	145,727,500	-
前受金	-	775,236,870
未払金	138,441,004	-
未払収益分配金	4,976,786,223	4,339,542,609
未払受託者報酬	74,875,094	87,761,599
未払委託者報酬	118,544,350	144,749,496
未払利息	229,492	97,792
受入担保金	140,120,776,176	177,861,009,160
その他未払費用	114,950,580	131,652,192
流動負債合計	145,690,330,419	183,340,049,718
負債合計	145,690,330,419	183,340,049,718
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	300,673,558,303	322,531,040,961
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△) (分配準備積立金)	122,597,280,549	215,792,618,634
	13,329,556	14,355,640
元本等合計	423,270,838,852	538,323,659,595
純資産合計	423,270,838,852	538,323,659,595
負債純資産合計	568,961,169,271	721,663,709,313

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第13期		第14期	
	自	令和2年1月17日	自	令和2年7月17日
	至	令和2年7月16日	至	令和3年1月16日
営業収益				
受取配当金		4,061,665,273		3,882,560,777
受取利息		652,692		20,838,058
有価証券売買等損益		△35,652,748,526		80,528,625,016
派生商品取引等損益		242,635,922		1,693,485,958
その他収益		1,229,497,782		820,895,352
営業収益合計		△30,118,296,857		86,946,405,161
営業費用				
支払利息		1,559,333		19,321,359
受託者報酬		74,875,094		87,761,599
委託者報酬		118,544,350		144,749,496
その他費用		115,197,623		131,893,040
営業費用合計		310,176,400		383,725,494
営業利益又は営業損失(△)		△30,428,473,257		86,562,679,667
経常利益又は経常損失(△)		△30,428,473,257		86,562,679,667
当期純利益又は当期純損失(△)		△30,428,473,257		86,562,679,667
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(△)		150,823,963,154		122,597,280,549
剰余金増加額又は欠損金減少額		13,561,673,162		13,430,602,287
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		13,561,673,162		13,430,602,287
剰余金減少額又は欠損金増加額		6,383,096,287		2,458,401,260
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		6,383,096,287		2,458,401,260
分配金		4,976,786,223		4,339,542,609
期末剰余金又は期末欠損金(△)		122,597,280,549		215,792,618,634

(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13期 [令和2年7月16日現在]	第14期 [令和3年1月16日現在]
1. 期首元本額	285,475,086,991円	300,673,558,303円
期中追加設定元本額	37,272,543,385円	26,922,255,408円
期中一部交換元本額	22,074,072,073円	5,064,772,750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	134,755,275,260円	169,172,885,790円
3. 受益権の総数	29,104,013口	31,219,731口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第13期 自 令和2年1月17日 至 令和2年7月16日	第14期 自 令和2年7月17日 至 令和3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。	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>5,290,256,414円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>8,476,432円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>5,298,732,846円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>308,617,067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>4,990,115,779円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>4,976,786,223円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>13,329,556円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>29,104,013口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金額</td> <td>I=F/H</td> <td>171円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	5,290,256,414円	分配準備積立金額	B	8,476,432円	配当等収益合計額	C=A+B	5,298,732,846円	経費	D	308,617,067円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	4,990,115,779円	収益分配金金額	F	4,976,786,223円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	13,329,556円	当ファンドの期末残存口数	H	29,104,013口	1口当たり分配金額	I=F/H	171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>4,704,972,828円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>13,329,556円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>4,718,302,384円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>364,404,135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>4,353,898,249円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>4,339,542,609円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>14,355,640円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>31,219,731口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金額</td> <td>I=F/H</td> <td>139円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	4,704,972,828円	分配準備積立金額	B	13,329,556円	配当等収益合計額	C=A+B	4,718,302,384円	経費	D	364,404,135円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	4,353,898,249円	収益分配金金額	F	4,339,542,609円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	14,355,640円	当ファンドの期末残存口数	H	31,219,731口	1口当たり分配金額	I=F/H	139円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	5,290,256,414円																																																											
分配準備積立金額	B	8,476,432円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	5,298,732,846円																																																											
経費	D	308,617,067円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	4,990,115,779円																																																											
収益分配金金額	F	4,976,786,223円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	13,329,556円																																																											
当ファンドの期末残存口数	H	29,104,013口																																																											
1口当たり分配金額	I=F/H	171円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	4,704,972,828円																																																											
分配準備積立金額	B	13,329,556円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	4,718,302,384円																																																											
経費	D	364,404,135円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	4,353,898,249円																																																											
収益分配金金額	F	4,339,542,609円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	14,355,640円																																																											
当ファンドの期末残存口数	H	31,219,731口																																																											
1口当たり分配金額	I=F/H	139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13期 自 令和2年1月17日 至 令和2年7月16日	第14期 自 令和2年7月17日 至 令和3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	当ファンドは、株式に投資しておりま	同左

<p>係るリスク</p>	<p>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。</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>3. 金融商品に係るリスク管理体制</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13期 [令和2年7月16日現在]	第14期 [令和3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。	(1) 有価証券 同左
	(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。	(2) デリバティブ取引 同左
	(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。	(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13期 [令和2年7月16日現在]	第14期 [令和3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	△29,968,378,194	76,349,042,320
合計	△29,968,378,194	76,349,042,320

(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13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	5,863,819,150	—	5,719,525,000	△144,294,150
	合計	5,863,819,150	—	5,719,525,000	△144,294,150

第14期 [令和3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	7,460,534,830	—	7,858,957,500	398,422,670
	合計	7,460,534,830	—	7,858,957,500	398,422,670

(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はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

	第13期	第14期
	自 令和2年1月17日 至 令和2年7月16日	自 令和2年7月17日 至 令和3年1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 利息の受取	同左
取引の種類別取引金額	有価証券の貸付 一円 品貸料の受取 23,808,726円 利息の受取 10,883,147円	有価証券の貸付 一円 品貸料の受取 22,118,589円 利息の受取 9,297,902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、担保金を受入れております。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 78,547,731,083円 その他未収収益 2,629,537円 未収利息 931,719円	受入担保金 67,429,789,559円 その他未収収益 1,706,105円 未収利息 368,904円

	第13期 自 令和2年1月17日 至 令和2年7月16日	第14期 自 令和2年7月17日 至 令和3年1月16日
関連当事者の名称	該当事項はありません。	モルガン・スタンレーMUF G証券株式会社
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
取引の内容		有価証券の貸付 品貸料の受取 利息の受取
取引の種類別取引金額		有価証券の貸付 1円 品貸料の受取 1,061,146円 利息の受取 188,258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。
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 651,066,570円 その他未収収益 52,042円 未収利息 5,841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13期 [令和2年7月16日現在]	第14期 [令和3年1月16日現在]
1口当たり純資産額	14,543円	17,243円