

平成30年1月期（平成29年7月17日～平成30年1月16日）決算短信

平成30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（10%）上場投 上場取引所 東証
信

コード番号 1574

連動対象指標 S&P/JPX リスク・コントロール指数（10%）

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 <https://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30年 4月13日

分配金支払開始予定日 平成30年 2月23日

I ファンドの運用状況

1. 平成30年1月期の運用状況（平成29年7月17日～平成30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30年1月期	776	(100.5)	△3	(△0.5)	773	(100.0)
平成29年7月期	664	(100.3)	△2	(△0.3)	662	(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30年1月期	420	—	—	420
平成29年7月期	420	—	—	420

(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30年1月期	779	6	773	184,077
平成29年7月期	667	4	662	157,771

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
平成30年1月期	127
平成29年7月期	83

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トピックスリスクコントロール（10%）上場投信】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第10期 [平成29年7月16日現在]	第11期 [平成30年1月16日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,212,490	2,532,481
投資信託受益証券	664,856,087	776,976,299
流動資産合計	667,068,577	779,508,780
資産合計	667,068,577	779,508,780
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,486,000	5,334,000
未払受託者報酬	102,698	114,950
未払委託者報酬	616,108	689,664
未払利息	9	3
その他未払費用	224,279	248,040
流動負債合計	4,429,094	6,386,657
負債合計	4,429,094	6,386,657
純資産の部		
元本等		
元本	420,000,000	420,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	242,639,483	353,122,123
（分配準備積立金）	12,561	6,305
元本等合計	662,639,483	773,122,123
純資産合計	662,639,483	773,122,123
負債純資産合計	667,068,577	779,508,780

（2）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期		第11期	
	自 平成29年1月17日 至 平成29年7月16日		自 平成29年7月17日 至 平成30年1月16日	
営業収益				
受取配当金		4,428,678		6,388,498
受取利息		10		8
有価証券売買等損益		35,030,292		110,488,896
営業収益合計		39,458,980		116,877,402
営業費用				
支払利息		428		550
受託者報酬		102,698		114,950
委託者報酬		616,108		689,664
その他費用		232,155		255,598
営業費用合計		951,389		1,060,762
営業利益又は営業損失（△）		38,507,591		115,816,640
経常利益又は経常損失（△）		38,507,591		115,816,640
当期純利益又は当期純損失（△）		38,507,591		115,816,640
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（△）		207,617,892		242,639,483
分配金		3,486,000		5,334,000
期末剰余金又は期末欠損金（△）		242,639,483		353,122,123

(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10期 [平成29年7月16日現在]	第11期 [平成30年1月16日現在]
1 期首元本額	420,000,000円	420,000,000円
期中追加設定元本額	—	—
期中一部解約元本額	—	—
2 受益権の総数	420,000口	420,000口
3 1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	1,577.71円 (157,771円)	1,840.77円 (184,077円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期(自平成29年1月17日 至平成29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	4,428,260円
分配準備積立金額	B	21,262円
配当等収益合計額	C=A+B	4,449,522円
経費	D	950,961円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	3,498,561円
収益分配金金額	F	3,486,000円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	12,561円
当ファンドの期末残存口数	H	420,000口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	830円

第11期(自平成29年7月17日 至平成30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	6,387,956円
分配準備積立金額	B	12,561円
配当等収益合計額	C=A+B	6,400,517円
経費	D	1,060,212円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	5,340,305円
収益分配金金額	F	5,334,000円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	6,305円
当ファンドの期末残存口数	H	420,000口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,270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10期 (自平成29年1月17日 至平成29年7月16日)	第11期 (自平成29年7月17日 至平成30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。 当社運用の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 10 期 (自平成29年 1月17日 至平成29年 7月16日)	第 11 期 (自平成29年 7月17日 至平成30年 1月16日)
3 金融商品に係るリスク 管理体制	<p>また、当社運用の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。</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。</p>	<p>同 左</p> <p>同 左</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 10 期 [平成29年7月16日現在]	第 11 期 [平成30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	<p>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>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>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>同 左</p> <p>同 左</p> <p>同 左</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 10 期 [平成29年7月16日現在]	第 11 期 [平成30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	35,011,600	110,407,027
合計	35,011,600	110,407,027

(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。