

令和2年1月期（令和1年7月17日～令和2年1月16日）決算短信

令和2年2月21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 宇野 誠朗 TEL (03)6250-4910

有価証券報告書提出予定日 令和2年4月15日
 分配金支払開始予定日 令和2年2月21日

I ファンドの運用状況

1. 令和2年1月期の運用状況（令和1年7月17日～令和2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2年1月期	432,309	(99.1)	3,989	(0.9)	436,299	(100.0)
令和1年7月期	361,463	(99.3)	2,700	(0.7)	364,163	(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1月期	25,620	2,699	687	27,632
令和1年7月期	21,627	4,383	390	25,620

(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1月期	440,990	4,690	436,299	15,789
令和1年7月期	368,700	4,536	364,163	14,214

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
令和2年1月期	157
令和1年7月期	165

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11期 [令和1年7月16日現在]	第12期 [令和2年1月16日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,394,280,634	7,664,919,491
株式	361,463,010,370	432,309,657,070
派生商品評価勘定	23,199,074	28,092,819
未収入金	33,168,195	37,079,640
未収配当金	587,769,080	721,368,800
差入委託証拠金	199,080,000	228,905,000
流動資産合計	368,700,507,353	440,990,022,820
資産合計	368,700,507,353	440,990,022,820
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	97,296	20,050
前受金	78,506,762	78,064,069
未払収益分配金	4,227,435,300	4,338,359,177
未払受託者報酬	50,623,025	60,989,629
未払委託者報酬	90,398,208	108,909,979
未払利息	13,872	7,234
その他未払費用	89,746,692	104,622,537
流動負債合計	4,536,821,155	4,690,972,675
負債合計	4,536,821,155	4,690,972,675
純資産の部		
元本等		
元本	264,688,691,420	285,475,086,991
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	99,474,994,778	150,823,963,154
(分配準備積立金)	8,904,520	8,476,432
元本等合計	364,163,686,198	436,299,050,145
純資産合計	364,163,686,198	436,299,050,145
負債純資産合計	368,700,507,353	440,990,022,820

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第11期 自 平成31年1月17日 至 令和1年7月16日	第12期 自 令和1年7月17日 至 令和2年1月16日
営業収益		
受取配当金	4,463,359,901	4,610,505,022
受取利息	516	14,789
有価証券売買等損益	6,548,015,578	41,374,171,977
派生商品取引等損益	△11,613,469	720,139,576
その他収益	3,589,115	3,314,921
営業収益合計	11,003,351,641	46,708,146,285
営業費用		
支払利息	898,239	1,109,327
受託者報酬	50,623,025	60,989,629
委託者報酬	90,398,208	108,909,979
その他費用	90,031,348	104,894,708
営業費用合計	231,950,820	275,903,643
営業利益又は営業損失(△)	10,771,400,821	46,432,242,642
経常利益又は経常損失(△)	10,771,400,821	46,432,242,642
当期純利益又は当期純損失(△)	10,771,400,821	46,432,242,642
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(△)	76,949,775,785	99,474,994,778
剰余金増加額又は欠損金減少額	17,624,483,892	12,169,239,387
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	17,624,483,892	12,169,239,387
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,643,230,420	2,914,154,476
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,643,230,420	2,914,154,476
分配金	4,227,435,300	4,338,359,177
期末剰余金又は期末欠損金(△)	99,474,994,778	150,823,963,154

(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11期 [令和1年7月16日現在]	第12期 [令和2年1月16日現在]
1. 期首元本額	223,437,194,378円	264,688,691,420円
期中追加設定元本額	45,288,335,292円	27,883,833,895円
期中一部交換元本額	4,036,838,250円	7,097,438,324円
2. 受益権の総数	25,620,820口	27,632,861口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第11期 自平成31年1月17日 至令和1年7月16日	第12期 自令和1年7月17日 至令和2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	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																																																												
<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>4,466,051,293円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>1,341,108円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>4,467,392,401円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>231,052,581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>4,236,339,820円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>4,227,435,300円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>8,904,520円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>25,620,820口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金額</td> <td>I=F/H</td> <td>165円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	4,466,051,293円	分配準備積立金額	B	1,341,108円	配当等収益合計額	C=A+B	4,467,392,401円	経費	D	231,052,581円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	4,236,339,820円	収益分配金金額	F	4,227,435,300円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	8,904,520円	当ファンドの期末残存口数	H	25,620,820口	1口当たり分配金額	I=F/H	165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>4,612,725,405円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>8,904,520円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>4,621,629,925円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>274,794,316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>4,346,835,609円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>4,338,359,177円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>8,476,432円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>27,632,861口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金額</td> <td>I=F/H</td> <td>157円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	4,612,725,405円	分配準備積立金額	B	8,904,520円	配当等収益合計額	C=A+B	4,621,629,925円	経費	D	274,794,316円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	4,346,835,609円	収益分配金金額	F	4,338,359,177円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	8,476,432円	当ファンドの期末残存口数	H	27,632,861口	1口当たり分配金額	I=F/H	157円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	4,466,051,293円																																																											
分配準備積立金額	B	1,341,108円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	4,467,392,401円																																																											
経費	D	231,052,581円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	4,236,339,820円																																																											
収益分配金金額	F	4,227,435,300円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	8,904,520円																																																											
当ファンドの期末残存口数	H	25,620,820口																																																											
1口当たり分配金額	I=F/H	165円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	4,612,725,405円																																																											
分配準備積立金額	B	8,904,520円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	4,621,629,925円																																																											
経費	D	274,794,316円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	4,346,835,609円																																																											
収益分配金金額	F	4,338,359,177円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	8,476,432円																																																											
当ファンドの期末残存口数	H	27,632,861口																																																											
1口当たり分配金額	I=F/H	157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11期 自平成31年1月17日 至令和1年7月16日	第12期 自令和1年7月17日 至令和2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

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</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11期 [令和1年7月16日現在]	第12期 [令和2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>(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11期 [令和1年7月16日現在]	第12期 [令和2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	6,194,240,635	41,536,492,639
合計	6,194,240,635	41,536,492,639

(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11期 [令和1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	2,679,653,458	—	2,702,842,500	23,189,042
合計		2,679,653,458	—	2,702,842,500	23,189,042

第12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	3,958,753,851	—	3,986,877,000	28,123,149
合計		3,958,753,851	—	3,986,877,000	28,123,149

(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。

(1口当たり情報)

	第11期 [令和1年7月16日現在]	第12期 [令和2年1月16日現在]
1口当たり純資産額	14,214円	15,789円