

# 平成24年1月期（平成23年7月17日～平成24年1月16日）決算短信

平成24年2月20日

ファンド名 MAXIS S&P三菱系企業群上場投信  
 コード番号 1670  
 連動対象指標 S&P 企業グループ指数-三菱系企業群-  
 主要投資資産 株式  
 売買単位 100口  
 管理会社 三菱UFJ投信株式会社  
 代表者名 取締役社長 後藤 俊夫  
 問合せ先責任者 ディスクロージャー部長 井上 靖

上場取引所 東証

URL <http://www.am.mufg.jp/>

TEL (03)6250-4910

有価証券報告書提出予定日 平成24年 4月13日  
 分配金支払開始予定日 平成24年 2月24日

## ファンドの運用状況

### 1. 平成24年1月期の運用状況（平成23年7月17日～平成24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24年1月期	3,490	( 99.0 )	34	( 1.0 )	3,525	( 100.0 )
平成23年7月期	25,858	( 99.9 )	34	( 0.1 )	25,892	( 100.0 )

#### (2)設定・交換実績

	前計算期間末 発行済口数( )	設定口数( )	交換口数( )	当計算期間末 発行済口数 ( + - )
	千口	千口	千口	千口
平成24年1月期	252,002		208,397	43,605
平成23年7月期	966,472		714,470	252,002

#### (3)基準価額

	総資産 ( )	負債 ( )	純資産 ( ( - ) )	100口当たり基準価額 ( ( / 当計算期間末発行済口数) × 100)
	百万円	百万円	百万円	円
平成24年1月期	3,604	79	3,525	8,085
平成23年7月期	26,636	744	25,892	10,275

#### (4)分配金

	100口当たり分配金
	円
平成24年1月期	83
平成23年7月期	208

### 2. 会計方針の変更

会計基準等の改正に伴う変更 無  
 以外の変更 無

## 財務諸表等

MAXIS S &amp; P三菱系企業群上場投信

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 [平成23年7月16日現在]	第5期 [平成24年1月16日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	698,738,565	106,598,677
株式	25,858,208,100	3,490,873,000
未収配当金	58,556,000	7,082,000
未収利息	3,020	242
その他未収収益	20,854,229	-
流動資産合計	26,636,359,914	3,604,553,919
資産合計	26,636,359,914	3,604,553,919
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	524,164,985	36,192,417
未払受託者報酬	19,226,554	3,009,511
未払委託者報酬	166,469,394	27,085,505
未払利息	319,515	-
その他未払費用	33,918,278	12,801,186
流動負債合計	744,098,726	79,088,619
負債合計	744,098,726	79,088,619
純資産の部		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 24,444,232,509	<sup>1</sup> 4,229,716,234
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	<sup>2</sup> 1,448,028,679	<sup>2</sup> 704,250,934
(分配準備積立金)	1,259,752	10,900
元本等合計	25,892,261,188	3,525,465,300
純資産合計	25,892,261,188	3,525,465,300
負債純資産合計	26,636,359,914	3,604,553,919

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期		第5期	
	自平成23年 至平成23年	1月17日 7月16日	自平成23年 至平成24年	7月17日 1月16日
営業収益				
受取配当金		555,513,300		77,811,520
受取利息		5,496,100		56,456
有価証券売買等損益		4,745,010,726		4,543,928,766
その他収益		182,761,664		14,440
営業収益合計		4,001,239,662		4,466,046,350
営業費用				
支払利息		3,846,071		-
受託者報酬		19,226,554		3,009,511
委託者報酬		166,469,394		27,085,505
その他費用	1	33,962,211	1	12,843,835
営業費用合計		223,504,230		42,938,851
営業利益		4,224,743,892		4,508,985,201
経常利益		4,224,743,892		4,508,985,201
当期純利益		4,224,743,892		4,508,985,201
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額		-		-
期首剰余金又は期首欠損金( )		12,395,629,063		1,448,028,679
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		2,392,898,005
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		2,392,898,005
剰余金減少額又は欠損金増加額		6,198,691,507		-
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		6,198,691,507		-
分配金	2	524,164,985	2	36,192,417
期末剰余金又は期末欠損金( )		1,448,028,679		704,250,934

(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	株式は移動平均法、株式以外の有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所における最終相場 で評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、 および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)または価格 提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認め られた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託 者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
-------------------	--

(貸借対照表に関する注記)

	第4期 [平成23年7月16日現在]	第5期 [平成24年1月16日現在]
1 期首元本額	93,747,831,142円	24,444,232,509円
期中追加設定元本額		
期中一部交換元本額	69,303,598,633円	20,214,516,275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。		704,250,934円
3 受益権の総数	252,002,397口	43,605,322口
4 1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	102.75円 (10,275円)	80.85円 (8,085円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期(自平成23年1月17日 至 平成23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	739,924,993円
分配準備積立金額	B	5,157,903円
配当等収益合計額	C=A+B	745,082,896円
経費	D	219,658,159円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	525,424,737円
収益分配金金額	F	524,164,985円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,259,752円
当ファンドの期末残存口数	H	252,002,397口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	208円

第5期(自平成23年7月17日 至 平成24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	77,882,416円
分配準備積立金額	B	1,259,752円
配当等収益合計額	C=A+B	79,142,168円
経費	D	42,938,851円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	36,203,317円
収益分配金金額	F	36,192,417円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	10,900円
当ファンドの期末残存口数	H	43,605,322口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	83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 4 期 (自平成23年1月17日 至平成23年7月16日)	第 5 期 (自平成23年7月17日 至平成24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。
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、株式を実質的な主要投資対象としております。株式の投資に係る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。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	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 4 期 [平成23年7月16日現在]	第 5 期 [平成24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。
2 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 (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。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (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。	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得ます。	同 左

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第 4 期 [平成23年7月16日現在]	第 5 期 [平成24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	1,420,663,256	905,324,141
合計	1,420,663,256	905,324,141

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

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。