

# 平成29年7月期（平成29年1月17日～平成29年7月16日）決算短信

平成29年8月21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 <http://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29年10月13日  
 分配金支払開始予定日 平成29年8月24日

## I ファンドの運用状況

### 1. 平成29年7月期の運用状況（平成29年1月17日～平成29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	%
平成29年7月期	664	( 100.3 )	△2	( △0.3 )	662	( 100.0 )
平成29年1月期	628	( 100.1 )	—	( △0.1 )	627	( 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29年7月期	420	—	—	420
平成29年1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29年7月期	667	4	662	157,771
平成29年1月期	630	2	627	149,433

#### (4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
平成29年7月期	83
平成29年1月期	42

### 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9期 [平成29年1月16日現在]	第10期 [平成29年7月16日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,108,900	2,212,490
投資信託受益証券	628,173,551	664,856,087
流動資産合計	630,282,451	667,068,577
資産合計	630,282,451	667,068,577
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,764,000	3,486,000
未払受託者報酬	97,918	102,698
未払委託者報酬	587,441	616,108
未払利息	3	9
その他未払費用	215,197	224,279
流動負債合計	2,664,559	4,429,094
負債合計	2,664,559	4,429,094
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（△）	207,617,892	242,639,483
（分配準備積立金）	21,262	12,561
元本等合計	627,617,892	662,639,483
純資産合計	627,617,892	662,639,483
負債純資産合計	630,282,451	667,068,577

## （2）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期		第10期	
	自 平成28年7月17日 至 平成29年1月16日		自 平成29年1月17日 至 平成29年7月16日	
営業収益				
受取配当金		2,673,182		4,428,678
受取利息		7		10
有価証券売買等損益		42,571,895		35,030,292
営業収益合計		45,245,084		39,458,980
営業費用				
支払利息		307		428
受託者報酬		97,918		102,698
委託者報酬		587,441		616,108
その他費用		223,311		232,155
営業費用合計		908,977		951,389
営業利益又は営業損失（△）		44,336,107		38,507,591
経常利益又は経常損失（△）		44,336,107		38,507,591
当期純利益又は当期純損失（△）		44,336,107		38,507,591
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（△）		165,045,785		207,617,892
分配金		1,764,000		3,486,000
期末剰余金又は期末欠損金（△）		207,617,892		242,639,483

## (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9期 [平成29年1月16日現在]	第10期 [平成29年7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)	1,494.33円 (149,433円)	1,577.71円 (157,771円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第9期（自平成28年7月17日 至 平成29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	2,672,882円
分配準備積立金額	B	21,050円
配当等収益合計額	C=A+B	2,693,932円
経費	D	908,670円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	1,785,262円
収益分配金金額	F	1,764,000円
次期繰越金（分配準備積立金）	G=E-F	21,262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	420円

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

(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9期 (自平成28年7月17日 至平成29年1月16日)	第10期 (自平成29年1月17日 至平成29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、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 9 期 (自平成28年7月17日 至平成29年1月16日)	第 10 期 (自平成29年1月17日 至平成29年7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 9 期 [平成29年1月16日現在]	第 10 期 [平成29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>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 9 期 [平成29年1月16日現在]	第 10 期 [平成29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)
投資信託受益証券	42,550,674	35,011,600
合計	42,550,674	35,011,600

(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。