平成24年7月期（平成24年1月17日～平成24年7月16日）決算短信

平成24年8月20日

ファンド名	ＭＡＸＩＳ Ｓ＆Ｐ東海上場投信	上場取引所　名証
コード番号	1553	
連動対象指標	Ｓ＆Ｐ 日本地域別指数-東海-	
主要投資資産	株式	
売買単位	10口	
管理会社	三菱ＵＦＪ投信株式会社	URL http://www.am.mufg.jp/
代表者名	取締役社長　　後藤　俊夫	
問合せ先責任者	商品ディスクロージャー部長　　井上　靖	TEL (03)6250-4910

有価証券報告書提出予定日　　平成24年10月15日
分配金支払開始予定日　　平成24年 8月24日

Ⅰ　ファンドの運用状況

１．平成24年7月期の運用状況（平成24年1月17日～平成24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24年7月期	1,884	(99.4)	12	(0.6)	1,896	(100.0)
平成24年1月期	1,801	(98.7)	24	(1.3)	1,825	(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
平成24年7月期	1,649	―	―	1,649
平成24年1月期	2,639	―	989	1,649

(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24年7月期	3,167	1,270	1,896	115,034
平成24年1月期	3,018	1,192	1,825	110,690

(4)分配金

	10口当たり分配金
	円
平成24年7月期	94
平成24年1月期	137

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　Ｓ＆Ｐ東海上場投信

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第 2 期 ［ 平成24年1月16日現在 ］	第 3 期 ［ 平成24年7月16日現在 ］
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,206,290,394	1,282,421,788
株式	※2 1,801,091,480	※2 1,884,722,700
未収入金	9,140,200	－
未収配当金	569,200	156,500
未収利息	2,749	11,588
その他未収収益	916,673	315,064
流動資産合計	3,018,010,696	3,167,627,640
資産合計	3,018,010,696	3,167,627,640
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	22,591,998	15,501,079
未払受託者報酬	869,409	767,528
未払委託者報酬	5,973,318	4,979,126
未払利息	25,697	27,751
受入担保金	1,162,010,640	1,248,778,860
その他未払費用	1,203,264	601,624
流動負債合計	1,192,674,326	1,270,655,968
負債合計	1,192,674,326	1,270,655,968
純資産の部		
元本等		
元本	※1 2,425,754,021	※1 2,425,754,021
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※3 △600,417,651	※3 △528,782,349
（分配準備積立金）	57,481	160,927
元本等合計	1,825,336,370	1,896,971,672
純資産合計	1,825,336,370	1,896,971,672
負債純資産合計	3,018,010,696	3,167,627,640

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 2 期 自 平成23年 7月17日 至 平成24年 1月16日	第 3 期 自 平成24年 1月17日 至 平成24年 7月16日
営業収益		
受取配当金	18,329,800	8,236,790
受取利息	511,067	546,027
有価証券売買等損益	△488,297,850	71,531,856
その他収益	12,210,096	13,555,027
営業収益合計	△457,246,887	93,869,700
営業費用		
支払利息	309,100	321,343
受託者報酬	869,409	767,528
委託者報酬	5,973,318	4,979,126
その他費用	※1 1,276,232	※1 665,322
営業費用合計	8,428,059	6,733,319
営業利益	△465,674,946	87,136,381
経常利益	△465,674,946	87,136,381
当期純利益	△465,674,946	87,136,381
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（△）	△378,872,986	△600,417,651
剰余金増加額又は欠損金減少額	266,722,279	－
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	266,722,279	－
分配金	※2 22,591,998	※2 15,501,079
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△600,417,651	△528,782,349

（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等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 2 期 ［ 平成24年1月16日現在 ］	第 3 期 ［ 平成24年7月16日現在 ］
※１ 期首元本額	3,881,969,000円	2,425,754,021円
期中追加設定元本額	―	―
期中一部交換元本額	1,456,214,979円	―
※２ 貸付有価証券 株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	1,108,410,000円	1,169,727,200円
※３ 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。	600,417,651円	528,782,349円
４ 受益権の総数	1,649,051口	1,649,051口
５ １口当たり純資産額 （100口当たり純資産額）	1,106.90円 （110,690円）	1,150.34円 （115,034円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第 2 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	30,741,863円
分配準備積立金額	B	26,575円
配当等収益合計額	C=A+B	30,768,438円
経費	D	8,118,959円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	22,649,479円
収益分配金金額	F	22,591,998円
次期繰越金（分配準備積立金）	G=E-F	57,481円
当ファンドの期末残存口数	H	1,649,051口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,370円

第 3 期（自 平成24年1月17日　至 平成24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	22,016,501円
分配準備積立金額	B	57,481円
配当等収益合計額	C=A+B	22,073,982円
経費	D	6,411,976円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	15,662,006円
収益分配金金額	F	15,501,079円
次期繰越金（分配準備積立金）	G=E-F	160,927円
当ファンドの期末残存口数	H	1,649,051口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	940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 2 期 （ 自 平成23年 7月17日 至 平成24年 1月16日 ）	第 3 期 （ 自 平成24年 1月17日 至 平成24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、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 2 期 ［ 平成24年1月16日現在 ］	第 3 期 ［ 平成24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	(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。	同　左
	(2) デリバティブ取引 該当事項はありません。	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。	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

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

	第 2 期 ［ 平成24年1月16日現在 ］	第 3 期 ［ 平成24年7月16日現在 ］
種　類	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	△344,994,766	71,728,700
合計	△344,994,766	71,728,700

（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。