

平成28年6月期（平成27年12月9日～平成28年6月8日）決算短信

平成28年7月13日

ファンド名 MAXIS Jリート上場投信
 コード番号 1597
 連動対象指標 東証REIT指数
 主要投資資産 投資証券
 売買単位 10口
 管理会社 三菱UFJ国際投信株式会社
 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

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28年 9月 7日
 分配金支払開始予定日 平成28年 7月 15日

I ファンドの運用状況

1. 平成28年6月期の運用状況（平成27年12月9日～平成28年6月8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28年6月期	46,392	(98.5)	725	(1.5)	47,117	(100.0)
平成27年12月期	38,645	(98.4)	628	(1.6)	39,274	(100.0)

(2) 設定・交換実績

	前特定期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当特定期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
平成28年6月期	22,362	5,864	3,397	24,829
平成27年12月期	21,406	4,947	3,991	22,362

(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/当特定期間末発行済口数)×100)
	百万円	百万円	百万円	円
平成28年6月期	47,391	273	47,117	189,764
平成27年12月期	39,597	323	39,274	175,624

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
平成28年6月期	276
平成27年12月期	253

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 Jリート上場投信】

(1) 【貸借対照表】

	前期	当期
	[平成27年12月8日現在]	[平成28年6月8日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	360,633,507	463,970,543
投資証券	38,645,848,300	46,392,726,400
派生商品評価勘定	1,362,240	—
未収入金	314,747,232	234,087,500
未収配当金	249,640,488	268,097,474
未収利息	574	—
前払金	—	504,400
差入委託証拠金	25,560,000	31,816,000
流動資産合計	39,597,792,341	47,391,202,317
資産合計	39,597,792,341	47,391,202,317
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	116,400
前受金	49,598,500	—
未払金	528,192	—
未払収益分配金	243,753,462	238,365,936
未払受託者報酬	4,064,930	4,817,222
未払委託者報酬	21,340,842	25,290,397
未払利息	—	744
その他未払費用	4,186,416	4,704,029
流動負債合計	323,472,342	273,294,728
負債合計	323,472,342	273,294,728
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	33,387,515,579	37,070,869,005
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	5,886,804,420	10,047,038,584
(分配準備積立金)	(836,520)	(914,128)
元本等合計	39,274,319,999	47,117,907,589
純資産合計	39,274,319,999	47,117,907,589
負債純資産合計	39,597,792,341	47,391,202,317

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	前期	当期
	自平成27年6月9日 至平成27年12月8日 金額(円)	自平成27年12月9日 至平成28年6月8日 金額(円)
営業収益		
受取配当金	636,116,324	711,699,896
受取利息	97,241	38,922
有価証券売買等損益	△2,145,426,379	3,161,399,144
派生商品取引等損益	2,508,092	56,600,072
その他収益	18,767,261	1,145,263
営業収益合計	△1,487,937,461	3,930,883,297
営業費用		
支払利息	—	42,776
受託者報酬	8,478,390	9,085,336
委託者報酬	44,511,471	47,697,964
その他費用 ※1	9,014,181	9,469,897
営業費用合計	62,004,042	66,295,973
営業利益又は営業損失(△)	△1,549,941,503	3,864,587,324
経常利益又は経常損失(△)	△1,549,941,503	3,864,587,324
当期純利益又は当期純損失(△)	△1,549,941,503	3,864,587,324
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(△)	7,484,802,014	5,886,804,420
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,332,033,170	2,350,278,866
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,332,033,170	2,350,278,866
剰余金減少額又は欠損金増加額	787,023,479	1,408,121,526
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	787,023,479	1,408,121,526
分配金 ※2	593,065,782	646,510,500
期末剰余金又は期末欠損金(△)	5,886,804,420	10,047,038,584

(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	投資証券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)

	前期 [平成27年12月8日現在]	当期 [平成28年6月8日現在]
※1 期首元本額	31,960,203,100円	33,387,515,579円
期中追加設定元本額	7,387,065,400円	8,755,101,300円
期中一部交換元本額	5,959,752,921円	5,071,747,874円
2 受益権の総数	22,362,703口	24,829,785口
3 1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	1,756.24円 (175,624円)	1,897.64円 (189,764円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期(自平成27年6月9日 至平成27年12月8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

(自平成27年6月9日 至平成27年9月8日)		
当期配当等収益額	A	381,503,684円
分配準備積立金額	B	925,518円
配当等収益合計額	C=A+B	382,429,202円
経費	D	32,207,265円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	350,221,937円
収益分配金金額	F	349,312,320円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	909,617円
当ファンドの期末残存口数	H	24,257,800口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,440円

(自平成27年9月9日 至平成27年12月8日)		
当期配当等収益額	A	273,477,142円
分配準備積立金額	B	909,617円
配当等収益合計額	C=A+B	274,386,759円
経費	D	29,796,777円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	244,589,982円
収益分配金金額	F	243,753,462円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	836,520円
当ファンドの期末残存口数	H	22,362,703口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,090円

当期(自平成27年12月9日 至平成28年6月8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

(自平成27年12月9日 至平成28年3月8日)		
当期配当等収益額	A	438,888,425円
分配準備積立金額	B	836,520円
配当等収益合計額	C=A+B	439,724,945円
経費	D	31,224,272円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	408,500,673円
収益分配金金額	F	408,144,564円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	356,109円
当ファンドの期末残存口数	H	22,674,698口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,800円

（自平成28年3月9日 至平成28年6月8日）		
当期配当等収益額	A	273,952,880円
分配準備積立金額	B	356,109円
配当等収益合計額	C=A+B	274,308,989円
経費	D	35,028,925円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	239,280,064円
収益分配金金額	F	238,365,936円
次期繰越金（分配準備積立金）	G=E-F	914,128円
当ファンドの期末残存口数	H	24,829,785口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	960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	前期 （自平成27年6月9日 至平成27年12月8日）	当期 （自平成27年12月9日 至平成28年6月8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。当ファンドは、運用の効率化を図るために、不動産投信指数先物取引を利用してしております。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
3 金融商品に係るリスク管理体制	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。 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 同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 [平成27年12月8日現在]	当期 [平成28年6月8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	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。 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。	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	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。 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	前期 [平成27年12月8日現在]	当期 [平成28年6月8日現在]
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	4,845,712,320	△10,465,157
合計	4,845,712,320	△10,465,157

(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

投資証券関連

区 分	種 類	前期 [平成27年12月8日現在]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建	619,560,000	—	621,000,000	1,440,000
	合 計	619,560,000	—	621,000,000	1,440,000

区 分	種 類	当期 [平成28年6月8日現在]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建	723,154,400	—	723,038,000	△116,400
	合 計	723,154,400	—	723,038,000	△116,400

(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。