

令和1年5月期（平成30年11月11日～令和1年5月10日）決算短信

令和1年6月14日
上場取引所 東証

ファンド名 MAXIS Jリート・コア上場投信
 コード番号 2517
 連動対象指標 東証REIT Core 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 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1年8月9日
 分配金支払開始予定日 令和1年6月18日

I ファンドの運用状況

1. 令和1年5月期の運用状況（平成30年11月11日～令和1年5月10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1年5月期	33,349	(98.5)	522	(1.5)	33,871	(100.0)
平成30年11月期	28,793	(98.4)	471	(1.6)	29,265	(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
令和1年5月期	28,245	5,429	3,320	30,353
平成30年11月期	23,056	5,188	—	28,245

(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
令和1年5月期	34,200	328	33,871	111,590
平成30年11月期	29,531	265	29,265	103,613

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
令和1年5月期	202
平成30年11月期	82

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)

	前期 [平成30年11月10日現在]	当期 [令和1年5月10日現在]
資産の部		
流動資産		
金銭信託	27,533,664	-
コール・ローン	229,864,869	507,575,622
投資証券	28,793,841,400	33,349,057,300
派生商品評価勘定	7,101,412	13,851,276
未収入金	232,126,718	7,496,944
未収配当金	232,533,603	309,645,069
差入委託証拠金	8,070,000	12,412,000
流動資産合計	29,531,071,666	34,200,038,211
資産合計	29,531,071,666	34,200,038,211
負債の部		
流動負債		
前受金	11,274,800	17,416,000
未払収益分配金	231,609,820	282,288,396
未払受託者報酬	2,959,111	3,607,225
未払委託者報酬	15,535,314	18,937,889
未払利息	1,046	576
その他未払費用	4,072,868	6,096,652
流動負債合計	265,452,959	328,346,738
負債合計	265,452,959	328,346,738
純資産の部		
元本等		
元本	27,906,158,800	29,989,347,908
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	1,359,459,907	3,882,343,565
(分配準備積立金)	1,682,934	2,139,733
元本等合計	29,265,618,707	33,871,691,473
純資産合計	29,265,618,707	33,871,691,473
負債純資産合計	29,531,071,666	34,200,038,211

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期		当期	
	自 平成30年8月11日 至 平成30年11月10日		自 平成30年11月11日 至 令和1年5月10日	
営業収益				
受取配当金		254,571,073		666,747,823
受取利息		222		128
有価証券売買等損益		223,981,173		2,399,760,785
派生商品取引等損益		7,332,080		61,349,080
その他収益		3		68
営業収益合計		485,884,551		3,127,857,884
営業費用				
支払利息		31,599		138,032
受託者報酬		2,959,111		6,961,805
委託者報酬		15,535,314		36,549,404
その他費用		4,084,039		10,719,053
営業費用合計		22,610,063		54,368,294
営業利益又は営業損失(△)		463,274,488		3,073,489,590
経常利益又は経常損失(△)		463,274,488		3,073,489,590
当期純利益又は当期純損失(△)		463,274,488		3,073,489,590
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(△)		910,846,537		1,359,459,907
剰余金増加額又は欠損金減少額		216,948,702		511,588,502
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		216,948,702		511,588,502
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		450,271,508
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		450,271,508
分配金		231,609,820		611,922,926
期末剰余金又は期末欠損金(△)		1,359,459,907		3,882,343,565

（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30年11月10日現在]	当期 [令和1年5月10日現在]
1. 期首元本額	22,779,920,800円	27,906,158,800円
期中追加設定元本額	5,126,238,000円	5,363,852,000円
期中一部交換元本額	—円	3,280,662,892円
2. 受益権の総数	28,245,100口	30,353,591口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期 自平成30年8月11日 至平成30年11月10日	当期 自平成30年11月11日 至令和1年5月10日																																																																																										
<p>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。</p> <p>2. 分配金の計算過程 第2期 平成30年8月11日 平成30年11月10日</p> <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>254,539,699円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>1,331,519円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>255,871,218円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>22,578,464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>233,292,754円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>231,609,820円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>1,682,934円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>28,245,100口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金額</td> <td>I=F/H*100</td> <td>820円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	254,539,699円	分配準備積立金額	B	1,331,519円	配当等収益合計額	C=A+B	255,871,218円	経費	D	22,578,464円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	233,292,754円	収益分配金金額	F	231,609,820円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,682,934円	当ファンドの期末残存口数	H	28,245,100口	100口当たり分配金額	I=F/H*100	820円	<p>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。</p> <p>2. 分配金の計算過程 第3期 平成30年11月11日 平成31年2月10日</p> <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>354,664,870円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>1,682,934円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>356,347,804円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>25,574,301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>330,773,503円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>329,634,530円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>1,138,973円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>30,241,700口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金額</td> <td>I=F/H*100</td> <td>1,090円</td> </tr> </tbody> </table> <p>第4期 平成31年2月11日 令和1年5月10日</p> <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>311,945,117円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>1,138,973円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>313,084,090円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>28,655,961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>284,428,129円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>282,288,396円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>2,139,733円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>30,353,591口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金額</td> <td>I=F/H*100</td> <td>930円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	354,664,870円	分配準備積立金額	B	1,682,934円	配当等収益合計額	C=A+B	356,347,804円	経費	D	25,574,301円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	330,773,503円	収益分配金金額	F	329,634,530円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,138,973円	当ファンドの期末残存口数	H	30,241,700口	100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,090円	項目			当期配当等収益額	A	311,945,117円	分配準備積立金額	B	1,138,973円	配当等収益合計額	C=A+B	313,084,090円	経費	D	28,655,961円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	284,428,129円	収益分配金金額	F	282,288,396円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,139,733円	当ファンドの期末残存口数	H	30,353,591口	100口当たり分配金額	I=F/H*100	930円
項目																																																																																											
当期配当等収益額	A	254,539,699円																																																																																									
分配準備積立金額	B	1,331,519円																																																																																									
配当等収益合計額	C=A+B	255,871,218円																																																																																									
経費	D	22,578,464円																																																																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	233,292,754円																																																																																									
収益分配金金額	F	231,609,820円																																																																																									
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,682,934円																																																																																									
当ファンドの期末残存口数	H	28,245,100口																																																																																									
100口当たり分配金額	I=F/H*100	820円																																																																																									
項目																																																																																											
当期配当等収益額	A	354,664,870円																																																																																									
分配準備積立金額	B	1,682,934円																																																																																									
配当等収益合計額	C=A+B	356,347,804円																																																																																									
経費	D	25,574,301円																																																																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	330,773,503円																																																																																									
収益分配金金額	F	329,634,530円																																																																																									
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,138,973円																																																																																									
当ファンドの期末残存口数	H	30,241,700口																																																																																									
100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,090円																																																																																									
項目																																																																																											
当期配当等収益額	A	311,945,117円																																																																																									
分配準備積立金額	B	1,138,973円																																																																																									
配当等収益合計額	C=A+B	313,084,090円																																																																																									
経費	D	28,655,961円																																																																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	284,428,129円																																																																																									
収益分配金金額	F	282,288,396円																																																																																									
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,139,733円																																																																																									
当ファンドの期末残存口数	H	30,353,591口																																																																																									
100口当たり分配金額	I=F/H*100	930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30年8月11日 至平成30年11月10日	当期 自平成30年11月11日 至令和1年5月10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。 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。	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	前期 [平成30年11月10日現在]	当期 [令和1年5月10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。 (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。 (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。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	前期 [平成30年11月10日現在]	当期 [令和1年5月10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	221,707,854	834,848,611
合計	221,707,854	834,848,611

(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

前期 [平成30年11月10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	不動産投信指数先物取引				
	買建	465,931,200	—	473,036,500	7,105,300
合計		465,931,200	—	473,036,500	7,105,300

当期 [令和1年5月10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	不動産投信指数先物取引				
	買建	506,132,400	—	519,984,000	13,851,600
合計		506,132,400	—	519,984,000	13,851,600

(注) 時価の算定方法

- 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。
 - 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
 - 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)

	前期 [平成30年11月10日現在]	当期 [令和1年5月10日現在]
1口当たり純資産額	1,036.13円	1,115.90円
(100口当たり純資産額)	(103,613円)	(111,590円)