

令和2年6月期（令和1年12月9日～令和2年6月8日）決算短信

令和2年7月16日
上場取引所 東証

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 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 笠間 悦男 TEL (03)6250-4910

有価証券報告書提出予定日 令和2年9月7日
分配金支払開始予定日 令和2年7月17日

I ファンドの運用状況

1. 令和2年6月期の運用状況（令和1年12月9日～令和2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	%
令和2年6月期	127,869	(97.8)	2,848	(2.2)	130,717	(100.0)
令和1年12月期	160,674	(98.5)	2,490	(1.5)	163,165	(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2年6月期	73,511	12,055	12,291	73,274
令和1年12月期	77,107	15,396	18,993	73,511

(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2年6月期	147,464	16,747	130,717	178,394
令和1年12月期	202,361	39,195	163,165	221,960

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
令和2年6月期	362
令和1年12月期	332

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 [令和1年12月8日現在]	当期 [令和2年6月8日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	39,767,641,552	18,022,526,067
投資証券	160,674,856,420	127,869,410,450
派生商品評価勘定	67,702,136	150,282,720
未収入金	840,266,848	2,305,350
未収配当金	829,162,395	863,332,519
未収利息	1,427,628	913,872
その他未収収益	114,603,289	92,246,960
差入委託証拠金	65,607,500	463,904,000
流動資産合計	202,361,267,768	147,464,921,938
資産合計	202,361,267,768	147,464,921,938
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	138,330	49,917,710
前受金	64,712,500	4,499,000
未払金	-	23,711,720
未払収益分配金	838,027,292	879,297,804
未払受託者報酬	21,733,005	16,756,535
未払委託者報酬	96,693,887	73,153,632
未払利息	26,245	32,025
受入担保金	38,159,669,761	15,686,840,757
その他未払費用	14,890,176	13,029,394
流動負債合計	39,195,891,196	16,747,238,577
負債合計	39,195,891,196	16,747,238,577
純資産の部		
元本等		
元本	109,752,170,838	109,399,301,781
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	53,413,205,734	21,318,381,580
(分配準備積立金)	1,442,501	5,635,243
元本等合計	163,165,376,572	130,717,683,361
純資産合計	163,165,376,572	130,717,683,361
負債純資産合計	202,361,267,768	147,464,921,938

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期		当期	
	自 至	令和1年6月9日 令和1年12月8日	自 至	令和1年12月9日 令和2年6月8日
営業収益				
受取配当金		2,580,465,792		2,782,411,813
受取利息		114,066		73,353
有価証券売買等損益		19,797,907,594		△35,637,392,675
派生商品取引等損益		296,221,512		△422,064,270
その他収益		214,458,538		280,910,626
営業収益合計		22,889,167,502		△32,996,061,153
営業費用				
支払利息		927,736		192,347
受託者報酬		41,393,374		39,622,751
委託者報酬		187,110,730		173,057,986
その他費用		29,922,304		28,800,850
営業費用合計		259,354,144		241,673,934
営業利益又は営業損失(△)		22,629,813,358		△33,237,735,087
経常利益又は経常損失(△)		22,629,813,358		△33,237,735,087
当期純利益又は当期純損失(△)		22,629,813,358		△33,237,735,087
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(△)		35,703,158,322		53,413,205,734
剰余金増加額又は欠損金減少額		10,329,533,826		6,525,021,922
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		10,329,533,826		6,525,021,922
剰余金減少額又は欠損金増加額		12,709,858,933		2,564,581,873
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		12,709,858,933		2,564,581,873
分配金		2,539,440,839		2,817,529,116
期末剰余金又は期末欠損金(△)		53,413,205,734		21,318,381,580

(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 [令和1年12月8日現在]	当期 [令和2年6月8日現在]
1. 期首元本額	115,121,519,895円	109,752,170,838円
期中追加設定元本額	22,987,571,700円	17,998,861,500円
期中一部交換元本額	28,356,920,757円	18,351,730,557円
2. 貸付有価証券 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。 投資証券	36,349,998,780円	15,348,091,250円
3. 受益権の総数	73,511,166口	73,274,817口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 令和1年6月9日 至 令和1年12月8日			当期 自 令和1年12月9日 至 令和2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。			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 第23期 令和1年6月9日 令和1年9月8日			2. 分配金の計算過程 第25期 令和1年12月9日 令和2年3月8日																																																												
<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>1,824,299,551円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金額</td><td>B</td><td>5,199,088円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>1,829,498,639円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>124,804,824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>1,704,693,815円</td></tr> <tr><td>収益分配金金額</td><td>F</td><td>1,701,413,547円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>3,280,268円</td></tr> <tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>H</td><td>78,046,493口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金額</td><td>I=F/H*100</td><td>2,180円</td></tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	1,824,299,551円	分配準備積立金額	B	5,199,088円	配当等収益合計額	C=A+B	1,829,498,639円	経費	D	124,804,824円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	1,704,693,815円	収益分配金金額	F	1,701,413,547円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	3,280,268円	当ファンドの期末残存口数	H	78,046,493口	100口当たり分配金額	I=F/H*100	2,180円			<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>2,080,166,639円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金額</td><td>B</td><td>1,442,501円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>2,081,609,140円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>138,243,090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>1,943,366,050円</td></tr> <tr><td>収益分配金金額</td><td>F</td><td>1,938,231,312円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>5,134,738円</td></tr> <tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>H</td><td>80,092,203口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金額</td><td>I=F/H*100</td><td>2,420円</td></tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	2,080,166,639円	分配準備積立金額	B	1,442,501円	配当等収益合計額	C=A+B	2,081,609,140円	経費	D	138,243,090円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	1,943,366,050円	収益分配金金額	F	1,938,231,312円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	5,134,738円	当ファンドの期末残存口数	H	80,092,203口	100口当たり分配金額	I=F/H*100	2,420円
項目																																																															
当期配当等収益額	A	1,824,299,551円																																																													
分配準備積立金額	B	5,199,088円																																																													
配当等収益合計額	C=A+B	1,829,498,639円																																																													
経費	D	124,804,824円																																																													
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	1,704,693,815円																																																													
収益分配金金額	F	1,701,413,547円																																																													
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	3,280,268円																																																													
当ファンドの期末残存口数	H	78,046,493口																																																													
100口当たり分配金額	I=F/H*100	2,180円																																																													
項目																																																															
当期配当等収益額	A	2,080,166,639円																																																													
分配準備積立金額	B	1,442,501円																																																													
配当等収益合計額	C=A+B	2,081,609,140円																																																													
経費	D	138,243,090円																																																													
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	1,943,366,050円																																																													
収益分配金金額	F	1,938,231,312円																																																													
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	5,134,738円																																																													
当ファンドの期末残存口数	H	80,092,203口																																																													
100口当たり分配金額	I=F/H*100	2,420円																																																													
第24期 令和1年9月9日 令和1年12月8日			第26期 令和2年3月9日 令和2年6月8日																																																												
<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>969,811,109円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金額</td><td>B</td><td>3,280,268円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>973,091,377円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>133,621,584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>839,469,793円</td></tr> <tr><td>収益分配金金額</td><td>F</td><td>838,027,292円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>1,442,501円</td></tr> <tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>H</td><td>73,511,166口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金額</td><td>I=F/H*100</td><td>1,140円</td></tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	969,811,109円	分配準備積立金額	B	3,280,268円	配当等収益合計額	C=A+B	973,091,377円	経費	D	133,621,584円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	839,469,793円	収益分配金金額	F	838,027,292円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,442,501円	当ファンドの期末残存口数	H	73,511,166口	100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,140円			<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>983,036,806円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金額</td><td>B</td><td>5,134,738円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>988,171,544円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>103,238,497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>884,933,047円</td></tr> <tr><td>収益分配金金額</td><td>F</td><td>879,297,804円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>5,635,243円</td></tr> <tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>H</td><td>73,274,817口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金額</td><td>I=F/H*100</td><td>1,200円</td></tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	983,036,806円	分配準備積立金額	B	5,134,738円	配当等収益合計額	C=A+B	988,171,544円	経費	D	103,238,497円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	884,933,047円	収益分配金金額	F	879,297,804円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	5,635,243円	当ファンドの期末残存口数	H	73,274,817口	100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,200円
項目																																																															
当期配当等収益額	A	969,811,109円																																																													
分配準備積立金額	B	3,280,268円																																																													
配当等収益合計額	C=A+B	973,091,377円																																																													
経費	D	133,621,584円																																																													
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	839,469,793円																																																													
収益分配金金額	F	838,027,292円																																																													
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,442,501円																																																													
当ファンドの期末残存口数	H	73,511,166口																																																													
100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,140円																																																													
項目																																																															
当期配当等収益額	A	983,036,806円																																																													
分配準備積立金額	B	5,134,738円																																																													
配当等収益合計額	C=A+B	988,171,544円																																																													
経費	D	103,238,497円																																																													
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	884,933,047円																																																													
収益分配金金額	F	879,297,804円																																																													
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	5,635,243円																																																													
当ファンドの期末残存口数	H	73,274,817口																																																													
100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,200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 令和 1年 6月 9日 至 令和 1年 12月 8日	当期 自 令和 1年 12月 9日 至 令和 2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 [令和 1年 12月 8日現在]	当期 [令和 2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	(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	同左

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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	前期 [令和1年12月8日現在]	当期 [令和2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	4,155,898,518	△19,395,511,949
合計	4,155,898,518	△19,395,511,949

(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 [令和1年12月8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	2,423,808,500	—	2,491,373,500	67,565,000
合計		2,423,808,500	—	2,491,373,500	67,565,000

当期 [令和2年6月8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	2,741,997,000	—	2,842,423,500	100,426,500
合計		2,741,997,000	—	2,842,423,500	100,426,500

(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)

	前期 自 令和1年6月9日 至 令和1年12月8日	当期 自 令和1年12月9日 至 令和2年6月8日
関連当事者の名称	三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	同左
関係内容	当該投資信託財産の運用の指図を行う投資信託委託会社の利害関係人等	同左

取引の内容	有価証券の貸付 品貸料の受取 利息の支払		同左
取引の種類別取引金額	有価証券の貸付 品貸料の受取 利息の支払	—円 13,706,510円 2,212,189円	有価証券の貸付 品貸料の受取 利息の支払 —円 5,203,000円 707,445円
取引条件及び取引条件の決定方針	社内規定に基づき、有価証券貸借取引契約を締結し、有価証券の貸付を行い、担保金を受入れています。取引条件は市場実勢を勘案して、合理的に決定しております。		同左
取引により発生した債権または債務に係る主な項目別の当該特定期間の末日における残高	受入担保金 その他未収収益 未払利息	5,059,337,766円 277,076円 25,960円	受入担保金 その他未収収益 未払利息 3,107,345,199円 155,983円 41,883円

(注)有価証券の貸付の取引金額については、取引に伴う洗替を日々行っているものであり、かつ金額が多額であるため記載しておりません。

(1口当たり情報)

	前期 [令和1年12月8日現在]	当期 [令和2年6月8日現在]
1口当たり純資産額	2,219.60円	1,783.94円
(100口当たり純資産額)	(221,960円)	(178,394円)