

令和2年12月期（令和2年6月9日～令和2年12月8日）決算短信

令和3年1月14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3年3月5日
 分配金支払開始予定日 令和3年1月15日

I ファンドの運用状況

1. 令和2年12月期の運用状況（令和2年6月9日～令和2年12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12月期	137,854	(98.6)	1,951	(1.4)	139,806	(100.0)
令和2年6月期	127,869	(97.8)	2,848	(2.2)	130,717	(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12月期	73,274	10,368	3,026	80,616
令和2年6月期	73,511	12,055	12,291	73,274

(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12月期	167,092	27,285	139,806	173,421
令和2年6月期	147,464	16,747	130,717	178,394

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
令和2年12月期	331
令和2年6月期	362

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 2 年 6 月 8 日現在]	当期 [令和 2 年 12 月 8 日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	18,022,526,067	27,112,902,845
投資証券	127,869,410,450	137,854,465,120
派生商品評価勘定	150,282,720	15,604,300
未収入金	2,305,350	559,261,563
未収配当金	863,332,519	955,896,520
未収利息	913,872	731,318
前払金	-	38,905,500
その他未収収益	92,246,960	68,908,791
差入委託証拠金	463,904,000	485,350,000
流動資産合計	147,464,921,938	167,092,025,957
資産合計	147,464,921,938	167,092,025,957
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	49,917,710	112,420
前受金	4,499,000	-
未払金	23,711,720	586,624,330
未払収益分配金	879,297,804	935,155,216
未払受託者報酬	16,756,535	18,559,182
未払委託者報酬	73,153,632	82,994,788
未払利息	32,025	18,763
受入担保金	15,686,840,757	25,648,355,820
その他未払費用	13,029,394	14,046,245
流動負債合計	16,747,238,577	27,285,866,764
負債合計	16,747,238,577	27,285,866,764
純資産の部		
元本等		
元本	109,399,301,781	120,360,925,697
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	21,318,381,580	19,445,233,496
(分配準備積立金)	5,635,243	6,033,165
元本等合計	130,717,683,361	139,806,159,193
純資産合計	130,717,683,361	139,806,159,193
負債純資産合計	147,464,921,938	167,092,025,957

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期		当期	
	自 至	令和1年12月9日 令和2年6月8日	自 至	令和2年6月9日 令和2年12月8日
営業収益				
受取配当金		2,782,411,813		2,544,541,046
受取利息		73,353		65,968
有価証券売買等損益		△35,637,392,675		△3,687,958,834
派生商品取引等損益		△422,064,270		△23,253,120
その他収益		280,910,626		294,445,043
営業収益合計		△32,996,061,153		△872,159,897
営業費用				
支払利息		192,347		△37,303
受託者報酬		39,622,751		36,812,157
委託者報酬		173,057,986		162,083,105
その他費用		28,800,850		28,308,127
営業費用合計		241,673,934		227,166,086
営業利益又は営業損失(△)		△33,237,735,087		△1,099,325,983
経常利益又は経常損失(△)		△33,237,735,087		△1,099,325,983
当期純利益又は当期純損失(△)		△33,237,735,087		△1,099,325,983
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(△)		53,413,205,734		21,318,381,580
剰余金増加額又は欠損金減少額		6,525,021,922		2,608,200,594
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		6,525,021,922		2,608,200,594
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,564,581,873		770,534,646
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,564,581,873		770,534,646
分配金		2,817,529,116		2,611,488,049
期末剰余金又は期末欠損金(△)		21,318,381,580		19,445,233,496

(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2年6月8日現在]	当期 [令和2年12月8日現在]
1. 期首元本額	109,752,170,838円	109,399,301,781円
期中追加設定元本額	17,998,861,500円	15,479,871,900円
期中一部交換元本額	18,351,730,557円	4,518,247,984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	15,348,091,250円	24,481,472,950円
3. 受益権の総数	73,274,817口	80,616,829口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 令和1年12月9日 至 令和2年6月8日	当期 自 令和2年6月9日 至 令和2年12月8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</p> <p>第25期 令和1年12月9日 令和2年3月8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>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> <p>第26期 令和2年3月9日 令和2年6月8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>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> </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	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	<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</p> <p>第27期 令和2年6月9日 令和2年9月8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>1,782,422,976円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>5,635,243円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>1,788,058,219円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>111,272,958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>1,676,785,261円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>1,676,332,833円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>452,428円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>77,968,969口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金額</td> <td>I=F/H*100</td> <td>2,150円</td> </tr> </tbody> </table> <p>第28期 令和2年9月9日 令和2年12月8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>1,056,666,384円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>452,428円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>1,057,118,812円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>115,930,431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>941,188,381円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>935,155,216円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>6,033,165円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	1,782,422,976円	分配準備積立金額	B	5,635,243円	配当等収益合計額	C=A+B	1,788,058,219円	経費	D	111,272,958円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	1,676,785,261円	収益分配金金額	F	1,676,332,833円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	452,428円	当ファンドの期末残存口数	H	77,968,969口	100口当たり分配金額	I=F/H*100	2,150円	項目			当期配当等収益額	A	1,056,666,384円	分配準備積立金額	B	452,428円	配当等収益合計額	C=A+B	1,057,118,812円	経費	D	115,930,431円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	941,188,381円	収益分配金金額	F	935,155,216円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	6,033,165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																																																																																																											
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																																																																																																											
項目																																																																																																													
当期配当等収益額	A	1,782,422,976円																																																																																																											
分配準備積立金額	B	5,635,243円																																																																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	1,788,058,219円																																																																																																											
経費	D	111,272,958円																																																																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	1,676,785,261円																																																																																																											
収益分配金金額	F	1,676,332,833円																																																																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	452,428円																																																																																																											
当ファンドの期末残存口数	H	77,968,969口																																																																																																											
100口当たり分配金額	I=F/H*100	2,150円																																																																																																											
項目																																																																																																													
当期配当等収益額	A	1,056,666,384円																																																																																																											
分配準備積立金額	B	452,428円																																																																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	1,057,118,812円																																																																																																											
経費	D	115,930,431円																																																																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	941,188,381円																																																																																																											
収益分配金金額	F	935,155,216円																																																																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	6,033,165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

当ファンドの期末残存口数	H	80,616,829 口
100 口当たり分配金額	I=F/H*100	1,160 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 12 月 9 日 至 令和 2 年 6 月 8 日	当期 自 令和 2 年 6 月 9 日 至 令和 2 年 12 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 2 年 6 月 8 日現在]	当期 [令和 2 年 12 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	(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	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 [令和2年6月8日現在]	当期 [令和2年12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	△19,395,511,949	△802,610,618
合計	△19,395,511,949	△802,610,618

(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

当期 [令和2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	1,933,824,700	—	1,949,319,000	15,494,300
	合計	1,933,824,700	—	1,949,319,000	15,494,300

(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	当期

	自 令和1年12月9日 至 令和2年6月8日	自 令和2年6月9日 至 令和2年12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 1円 品貸料の受取 5,203,000円 利息の支払 707,445円	有価証券の貸付 1円 品貸料の受取 3,395,858円 利息の支払 675,950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 3,107,345,199円 その他未収収益 155,983円 未払利息 41,883円	受入担保金 4,789,702,730円 その他未収収益 143,541円 未払利息 30,755円

	前期 自 令和1年12月9日 至 令和2年6月8日	当期 自 令和2年6月9日 至 令和2年12月8日
関連当事者の名称	該当事項はありません。	モルガン・スタンレーMUF G証券株式会社
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
取引の内容		有価証券の貸付 品貸料の受取 利息の支払
取引の種類別取引金額		有価証券の貸付 1円 品貸料の受取 205,966円 利息の支払 7,708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。
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 82,362,000円 その他未収収益 4,505円 未払利息 712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2年6月8日現在]	当期 [令和2年12月8日現在]
1口当たり純資産額	1,783.94円	1,734.21円
(100口当たり純資産額)	(178,394円)	(173,421円)