

2023年12月期（2023年6月9日～2023年12月8日）決算短信

2024年1月15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アセットマネジメント株式会社 URL <https://www.am.mufg.jp/>
 代表者名 取締役社長 横川 直
 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)4223-3038

有価証券報告書提出予定日 2024年3月7日
 分配金支払開始予定日 2024年1月16日

I ファンドの運用状況

1. 2023年12月期の運用状況（2023年6月9日～2023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	%
2023年12月期	183,911	(98.6)	2,573	(1.4)	186,484	(100.0)
2023年6月期	175,474	(97.9)	3,848	(2.1)	179,323	(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
2023年12月期	94,634	9,091	3,144	100,581
2023年6月期	82,760	15,906	4,032	94,634

(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
2023年12月期	219,388	32,904	186,484	185,406
2023年6月期	213,809	34,486	179,323	189,490

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
2023年12月期	373
2023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 [2023年6月8日現在]	当期 [2023年12月8日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	35,889,724,146	34,007,984,244
投資証券	175,474,971,000	183,911,358,200
未収入金	1,075,674,274	79,902,700
未収配当金	1,086,855,904	1,100,632,998
未収利息	2,041,532	104,059
前払金	-	10,624,000
その他未収収益	45,172,327	69,007,181
差入委託証拠金	235,312,000	209,060,703
流動資産合計	213,809,751,183	219,388,674,085
資産合計	213,809,751,183	219,388,674,085
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	16,527,290	5,879,410
前受金	1,334,400	-
未払金	-	3,031,960
未払収益分配金	1,069,372,008	1,176,804,544
未払受託者報酬	19,343,637	20,447,387
未払委託者報酬	55,004,369	58,731,477
未払利息	54,218	8,497
受入担保金	33,308,866,656	31,623,070,605
その他未払費用	15,527,414	16,271,008
流動負債合計	34,486,029,992	32,904,244,888
負債合計	34,486,029,992	32,904,244,888
純資産の部		
元本等		
元本	141,289,593,663	150,168,306,405
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	38,034,127,528	36,316,122,792
（分配準備積立金）	5,205,812	595,919
元本等合計	179,323,721,191	186,484,429,197
純資産合計	179,323,721,191	186,484,429,197
負債純資産合計	213,809,751,183	219,388,674,085

（2）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期		当期	
	自 2022年12月9日 至 2023年6月8日		自 2023年6月9日 至 2023年12月8日	
営業収益				
受取配当金	3,343,417,254		3,656,296,411	
受取利息	5,448,922		8,876,496	
有価証券売買等損益	△7,114,139,831		△4,057,856,216	
派生商品取引等損益	△52,875,910		△8,988,190	
その他収益	130,271,772		219,964,680	
営業収益合計	△3,687,877,793		△181,706,819	
営業費用				
支払利息	6,615,603		10,840,814	
受託者報酬	37,626,060		41,562,088	
委託者報酬	106,905,241		118,673,932	
その他費用	31,490,738		33,520,861	
営業費用合計	182,637,642		204,597,695	
営業利益又は営業損失（△）	△3,870,515,435		△386,304,514	
経常利益又は経常損失（△）	△3,870,515,435		△386,304,514	
当期純利益又は当期純損失（△）	△3,870,515,435		△386,304,514	
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（△）	40,462,701,847		38,034,127,528	
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,339,932,212		3,684,503,205	
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,339,932,212		3,684,503,205	
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,605,102,150		1,331,053,642	
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,605,102,150		1,331,053,642	
分配金	3,292,888,946		3,685,149,785	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	38,034,127,528		36,316,122,792	

(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。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌特定期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

	前期 [2023年6月8日現在]	当期 [2023年12月8日現在]
1. 期首元本額	123,561,039,813円	141,289,593,663円
期中追加設定元本額	23,748,703,100円	13,573,460,200円
期中一部交換元本額	6,020,149,250円	4,694,747,458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	31,369,038,300円	29,834,756,300円
3. 受益権の総数	94,634,691口	100,581,585口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2022年12月9日 至 2023年6月8日	当期 自 2023年6月9日 至 2023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。	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37期 2022年12月9日 2023年3月8日	2. 分配金の計算過程 第39期 2023年6月9日 2023年9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>2,311,171,985円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>1,594,452円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>2,312,766,437円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>85,773,523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>2,226,992,914円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>2,223,516,938円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>3,475,976円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>89,297,869口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金額</td> <td>I=F/H*100</td> <td>2,490円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	2,311,171,985円	分配準備積立金額	B	1,594,452円	配当等収益合計額	C=A+B	2,312,766,437円	経費	D	85,773,523円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	2,226,992,914円	収益分配金金額	F	2,223,516,938円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	3,475,976円	当ファンドの期末残存口数	H	89,297,869口	100口当たり分配金額	I=F/H*100	2,490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>2,602,447,182円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>5,205,812円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>2,607,652,994円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>97,898,676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>2,509,754,318円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>2,508,345,241円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>1,409,077円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>97,982,236口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金額</td> <td>I=F/H*100</td> <td>2,560円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	2,602,447,182円	分配準備積立金額	B	5,205,812円	配当等収益合計額	C=A+B	2,607,652,994円	経費	D	97,898,676円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	2,509,754,318円	収益分配金金額	F	2,508,345,241円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,409,077円	当ファンドの期末残存口数	H	97,982,236口	100口当たり分配金額	I=F/H*100	2,560円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	2,311,171,985円																																																											
分配準備積立金額	B	1,594,452円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	2,312,766,437円																																																											
経費	D	85,773,523円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	2,226,992,914円																																																											
収益分配金金額	F	2,223,516,938円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	3,475,976円																																																											
当ファンドの期末残存口数	H	89,297,869口																																																											
100口当たり分配金額	I=F/H*100	2,490円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	2,602,447,182円																																																											
分配準備積立金額	B	5,205,812円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	2,607,652,994円																																																											
経費	D	97,898,676円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	2,509,754,318円																																																											
収益分配金金額	F	2,508,345,241円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,409,077円																																																											
当ファンドの期末残存口数	H	97,982,236口																																																											
100口当たり分配金額	I=F/H*100	2,560円																																																											
第38期 2023年3月9日 2023年6月8日	第40期 2023年9月9日 2023年12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>1,161,350,360円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>3,475,976円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>1,164,826,336円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	1,161,350,360円	分配準備積立金額	B	3,475,976円	配当等収益合計額	C=A+B	1,164,826,336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>1,271,849,591円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>1,409,077円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>1,273,258,668円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	1,271,849,591円	分配準備積立金額	B	1,409,077円	配当等収益合計額	C=A+B	1,273,258,668円																																				
項目																																																													
当期配当等収益額	A	1,161,350,360円																																																											
分配準備積立金額	B	3,475,976円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	1,164,826,336円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	1,271,849,591円																																																											
分配準備積立金額	B	1,409,077円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	1,273,258,668円																																																											

経費	D	90,248,516円	経費	D	95,858,205円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	1,074,577,820円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	1,177,400,463円
収益分配金金額	F	1,069,372,008円	収益分配金金額	F	1,176,804,544円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	5,205,812円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	595,919円
当ファンドの期末残存口数	H	94,634,691口	当ファンドの期末残存口数	H	100,581,585口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,130円	100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,170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 2022年12月9日 至 2023年6月8日	当期 自 2023年6月9日 至 2023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、この結果はリスク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 [2023年6月8日現在]	当期 [2023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	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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
	(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。	(3) 上記以外の金融商品 同左
	金融商品の時価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 [2023年6月8日現在]	当期 [2023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	3,452,888,455	△8,725,201,472
合計	3,452,888,455	△8,725,201,472

(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 [2023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	3,860,303,600	—	3,843,779,500	△16,524,100
合計		3,860,303,600	—	3,843,779,500	△16,524,100

当期 [2023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	2,574,144,000	—	2,568,268,000	△5,876,000
合計		2,574,144,000	—	2,568,268,000	△5,876,000

(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 2022年12月9日 至 2023年6月8日	当期 自 2023年6月9日 至 2023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 利息の受取	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 666,625円 利息の受取 282,261円	有価証券の貸付 1円 品貸料の受取 1,337,526円 利息の受取 793,224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 2,691,956,295円 その他未収収益 42,336円 未収利息 36,706円	受入担保金 2,075,603,355円 その他未収収益 23,526円 未収利息 4,158円

	前期 自 2022年12月9日 至 2023年6月8日	当期 自 2023年6月9日 至 2023年12月8日
関連当事者の名称	モルガン・スタンレーMUFJ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 利息の受取	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 37,895円 利息の受取 610円	有価証券の貸付 1円 品貸料の受取 202,057円 利息の受取 54,218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 1円 その他未収収益 1円 未収利息 1円	受入担保金 556,689,105円 その他未収収益 21,357円 未収利息 2,002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 [2023年6月8日現在]	当期 [2023年12月8日現在]
1口当たり純資産額	1,894.90円	1,854.06円
(100口当たり純資産額)	(189,490円)	(185,406円)