

令和3年6月期（令和2年12月9日～令和3年6月8日）決算短信

令和3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 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)6250-4910

有価証券報告書提出予定日 令和3年9月7日
分配金支払開始予定日 令和3年7月16日

I ファンドの運用状況

1. 令和3年6月期の運用状況（令和2年12月9日～令和3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3年6月期	178,624	(98.1)	3,373	(1.9)	181,997	(100.0)
令和2年12月期	137,854	(98.6)	1,951	(1.4)	139,806	(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3年6月期	80,616	12,325	9,817	83,124
令和2年12月期	73,274	10,368	3,026	80,616

(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3年6月期	220,617	38,619	181,997	218,946
令和2年12月期	167,092	27,285	139,806	173,421

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
令和3年6月期	331
令和2年12月期	331

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 12 月 8 日現在]	当期 [令和 3 年 6 月 8 日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	27,112,902,845	39,447,645,024
投資証券	137,854,465,120	178,624,103,680
派生商品評価勘定	15,604,300	17,432,520
未収入金	559,261,563	1,318,915,534
未収配当金	955,896,520	945,231,719
未収利息	731,318	821,451
前払金	38,905,500	-
その他未収収益	68,908,791	89,987,076
差入委託証拠金	485,350,000	173,043,000
流動資産合計	167,092,025,957	220,617,180,004
資産合計	167,092,025,957	220,617,180,004
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	112,420	-
前受金	-	371,081,500
未払金	586,624,330	-
未払収益分配金	935,155,216	914,371,898
未払受託者報酬	18,559,182	22,358,393
未払委託者報酬	82,994,788	101,635,044
未払利息	18,763	28,672
受入担保金	25,648,355,820	37,194,751,282
その他未払費用	14,046,245	14,962,182
流動負債合計	27,285,866,764	38,619,188,971
負債合計	27,285,866,764	38,619,188,971
純資産の部		
元本等		
元本	120,360,925,697	124,105,203,974
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	19,445,233,496	57,892,787,059
(分配準備積立金)	6,033,165	5,828,484
元本等合計	139,806,159,193	181,997,991,033
純資産合計	139,806,159,193	181,997,991,033
負債純資産合計	167,092,025,957	220,617,180,004

（2）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期		当期	
	自 至	令和2年6月9日 令和2年12月8日	自 至	令和2年12月9日 令和3年6月8日
営業収益				
受取配当金		2,544,541,046		2,716,416,131
受取利息		65,968		2,955,037
有価証券売買等損益		△3,687,958,834		36,282,934,814
派生商品取引等損益		△23,253,120		632,256,500
その他収益		294,445,043		315,645,836
営業収益合計		△872,159,897		39,950,208,318
営業費用				
支払利息		△37,303		1,875,248
受託者報酬		36,812,157		42,589,434
委託者報酬		162,083,105		191,102,759
その他費用		28,308,127		30,270,845
営業費用合計		227,166,086		265,838,286
営業利益又は営業損失（△）		△1,099,325,983		39,684,370,032
経常利益又は経常損失（△）		△1,099,325,983		39,684,370,032
当期純利益又は当期純損失（△）		△1,099,325,983		39,684,370,032
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（△）		21,318,381,580		19,445,233,496
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,608,200,594		6,525,482,887
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,608,200,594		6,525,482,887
剰余金減少額又は欠損金増加額		770,534,646		4,992,915,957
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		770,534,646		4,992,915,957
分配金		2,611,488,049		2,769,383,399
期末剰余金又は期末欠損金（△）		19,445,233,496		57,892,787,059

(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)

当期 [令和3年6月8日現在]

当特定期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当特定期間の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 [令和2年12月8日現在]	当期 [令和3年6月8日現在]
1. 期首元本額	109,399,301,781円	120,360,925,697円
期中追加設定元本額	15,479,871,900円	18,401,971,500円
期中一部交換元本額	4,518,247,984円	14,657,693,223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	24,481,472,950円	36,143,890,670円
3. 受益権の総数	80,616,829口	83,124,718口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 令和2年6月9日 至 令和2年12月8日			当期 自 令和2年12月9日 至 令和3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27期 令和2年6月9日 令和2年9月8日			2. 分配金の計算過程 第29期 令和2年12月9日 令和3年3月8日		
項目			項目		
当期配当等収益額	A	1,782,422,976円	当期配当等収益額	A	1,975,455,463円
分配準備積立金額	B	5,635,243円	分配準備積立金額	B	6,033,165円
配当等収益合計額	C=A+B	1,788,058,219円	配当等収益合計額	C=A+B	1,981,488,628円
経費	D	111,272,958円	経費	D	124,675,580円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	1,676,785,261円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	1,856,813,048円
収益分配金金額	F	1,676,332,833円	収益分配金金額	F	1,855,011,501円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	452,428円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,801,547円
当ファンドの期末残存口数	H	77,968,969口	当ファンドの期末残存口数	H	83,937,172口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	2,150円	100口当たり分配金額	I=F/H*100	2,210円
第28期 令和2年9月9日 令和2年12月8日			第30期 令和3年3月9日 令和3年6月8日		
項目			項目		
当期配当等収益額	A	1,056,666,384円	当期配当等収益額	A	1,057,686,293円
分配準備積立金額	B	452,428円	分配準備積立金額	B	1,801,547円

配当等収益合計額	C=A+B	1,057,118,812円	配当等収益合計額	C=A+B	1,059,487,840円
経費	D	115,930,431円	経費	D	139,287,458円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	941,188,381円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	920,200,382円
収益分配金金額	F	935,155,216円	収益分配金金額	F	914,371,898円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	6,033,165円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	5,828,484円
当ファンドの期末残存口数	H	80,616,829口	当ファンドの期末残存口数	H	83,124,718口
100口当たり分配金金額	I=F/H*100	1,160円	100口当たり分配金金額	I=F/H*100	1,100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2年6月9日 至 令和2年12月8日	当期 自 令和2年12月9日 至 令和3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2年12月8日現在]	当期 [令和3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。	(1) 有価証券 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	(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。	(2) デリバティブ取引 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12月8日現在]	当期 [令和3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	△802,610,618	19,807,528,577
合計	△802,610,618	19,807,528,577

(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

当期 [令和3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	3,344,066,000	—	3,361,500,500	17,434,500
合計		3,344,066,000	—	3,361,500,500	17,434,500

(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 2 年 6 月 9 日 至 令和 2 年 12 月 8 日		自 令和 2 年 12 月 9 日 至 令和 3 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 利息の受取		同左	
取引の種類別取引金額	有価証券の貸付	—円	有価証券の貸付	—円
	品貸料の受取	3,395,858 円	品貸料の受取	3,274,194 円
	利息の受取	675,950 円	利息の受取	379,943 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	4,789,702,730 円	受入担保金	318,888,570 円
	その他未収収益	143,541 円	その他未収収益	14,185 円
	未収利息	30,755 円	未収利息	2,672 円

	前期		当期	
	自 令和 2 年 6 月 9 日 至 令和 2 年 12 月 8 日		自 令和 2 年 12 月 9 日 至 令和 3 年 6 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	—円	有価証券の貸付	—円
	品貸料の受取	205,966 円	品貸料の受取	241,420 円
	利息の受取	7,708 円	利息の受取	18,563 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	82,362,000 円	受入担保金	—円
	その他未収収益	4,505 円	その他未収収益	—円
	未収利息	712 円	未収利息	—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		当期	
	[令和 2 年 12 月 8 日現在]		[令和 3 年 6 月 8 日現在]	
1口当たり純資産額	1,734.21 円		2,189.46 円	
(100口当たり純資産額)	(173,421 円)		(218,946 円)	