

令和2年4月期（令和1年10月11日～令和2年4月10日）決算短信

令和2年5月18日
上場取引所 東証

ファンド名 MAXIS高利回りJリート上場投信
コード番号 1660
連動対象指標 野村高利回りJリート指数
主要投資資産 投資証券
売買単位 1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7月9日
分配金支払開始予定日 令和2年5月19日

I ファンドの運用状況

1. 令和2年4月期の運用状況（令和1年10月11日～令和2年4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2年4月期	10,008	(97.2)	287	(2.8)	10,295	(100.0)
令和1年10月期	12,936	(98.7)	170	(1.3)	13,106	(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4月期	1,097	309	98	1,309
令和1年10月期	967	140	9	1,097

(3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	1口当たり基準価額 (③/当特定期間末発行済口数)
	百万円	百万円	百万円	円
令和2年4月期	10,470	175	10,295	7,865
令和1年10月期	13,231	124	13,106	11,938

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
令和2年4月期	201
令和1年10月期	183

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 10 月 10 日現在]	当期 [令和 2 年 4 月 10 日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	174,083,392	115,549,008
投資証券	12,936,633,650	10,008,207,520
派生商品評価勘定	6,757,028	1,434,370
未収入金	4,259,140	127,870,900
未収配当金	105,516,690	130,794,384
前払金	-	37,602,670
差入委託証拠金	4,059,000	49,476,000
流動資産合計	13,231,308,900	10,470,934,852
資産合計	13,231,308,900	10,470,934,852
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	39,227,110
前受金	13,534,500	-
未払収益分配金	101,008,180	125,673,024
未払受託者報酬	1,263,051	1,311,315
未払委託者報酬	6,630,971	6,884,367
未払利息	57	104
その他未払費用	1,996,160	2,093,464
流動負債合計	124,432,919	175,189,384
負債合計	124,432,919	175,189,384
純資産の部		
元本等		
元本	9,533,195,945	11,366,863,202
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	3,573,680,036	△1,071,117,734
(分配準備積立金)	964,678	408,068
元本等合計	13,106,875,981	10,295,745,468
純資産合計	13,106,875,981	10,295,745,468
負債純資産合計	13,231,308,900	10,470,934,852

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期		当期	
	自 平成31年4月11日 至 令和1年10月10日		自 令和1年10月11日 至 令和2年4月10日	
営業収益				
受取配当金		214,631,008		270,913,105
受取利息		339		449
有価証券売買等損益		2,033,390,824		△4,589,927,315
派生商品取引等損益		40,124,358		△93,889,640
その他収益		6		3
営業収益合計		2,288,146,535		△4,412,903,398
営業費用				
支払利息		40,291		22,908
受託者報酬		2,372,032		2,785,435
委託者報酬		12,453,088		14,623,491
その他費用		3,989,110		4,659,454
営業費用合計		18,854,521		22,091,288
営業利益又は営業損失(△)		2,269,292,014		△4,434,994,686
経常利益又は経常損失(△)		2,269,292,014		△4,434,994,686
当期純利益又は当期純損失(△)		2,269,292,014		△4,434,994,686
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(△)		1,222,070,832		3,573,680,036
剰余金増加額又は欠損金減少額		300,308,442		290,514,339
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		300,308,442		290,514,339
剰余金減少額又は欠損金増加額		22,539,177		250,938,544
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		22,539,177		194,415,250
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		56,523,294
分配金		195,452,075		249,378,879
期末剰余金又は期末欠損金(△)		3,573,680,036		△1,071,117,734

(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10月10日現在]	当期 [令和2年4月10日現在]
1. 期首元本額	8,402,678,028円	9,533,195,945円
期中追加設定元本額	1,215,967,320円	2,686,337,857円
期中一部交換元本額	85,449,403円	852,670,600円
2. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	—円	1,071,117,734円
3. 受益権の総数	1,097,915口	1,309,094口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自平成31年4月11日 至令和1年10月10日	当期 自令和1年10月11日 至令和2年4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7期 平成31年4月11日 令和1年7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>103,316,648円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金額</td><td>B</td><td>639,921円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>103,956,569円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>8,817,489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>95,139,080円</td></tr> <tr><td>収益分配金金額</td><td>F</td><td>94,443,895円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>695,185円</td></tr> <tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>H</td><td>1,037,845口</td></tr> <tr><td>1口当たり分配金額</td><td>I=F/H</td><td>91円</td></tr> </tbody> </table> <p>第8期 令和1年7月11日 令和1年10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>111,274,414円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金額</td><td>B</td><td>695,185円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>111,969,599円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>9,996,741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>101,972,858円</td></tr> <tr><td>収益分配金金額</td><td>F</td><td>101,008,180円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>964,678円</td></tr> <tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>H</td><td>1,097,915口</td></tr> <tr><td>1口当たり分配金額</td><td>I=F/H</td><td>92円</td></tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	103,316,648円	分配準備積立金額	B	639,921円	配当等収益合計額	C=A+B	103,956,569円	経費	D	8,817,489円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	95,139,080円	収益分配金金額	F	94,443,895円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	695,185円	当ファンドの期末残存口数	H	1,037,845口	1口当たり分配金額	I=F/H	91円	項目			当期配当等収益額	A	111,274,414円	分配準備積立金額	B	695,185円	配当等収益合計額	C=A+B	111,969,599円	経費	D	9,996,741円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	101,972,858円	収益分配金金額	F	101,008,180円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	964,678円	当ファンドの期末残存口数	H	1,097,915口	1口当たり分配金額	I=F/H	92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9期 令和1年10月11日 令和2年1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>134,871,399円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金額</td><td>B</td><td>964,678円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>135,836,077円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>11,622,139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>124,213,938円</td></tr> <tr><td>収益分配金金額</td><td>F</td><td>123,705,855円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>508,083円</td></tr> <tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>H</td><td>1,178,151口</td></tr> <tr><td>1口当たり分配金額</td><td>I=F/H</td><td>105円</td></tr> </tbody> </table> <p>第10期 令和2年1月11日 令和2年4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>136,019,250円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金額</td><td>B</td><td>508,083円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>136,527,333円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>10,446,241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>126,081,092円</td></tr> <tr><td>収益分配金金額</td><td>F</td><td>125,673,024円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>408,068円</td></tr> <tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>H</td><td>1,309,094口</td></tr> <tr><td>1口当たり分配金額</td><td>I=F/H</td><td>96円</td></tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	134,871,399円	分配準備積立金額	B	964,678円	配当等収益合計額	C=A+B	135,836,077円	経費	D	11,622,139円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	124,213,938円	収益分配金金額	F	123,705,855円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	508,083円	当ファンドの期末残存口数	H	1,178,151口	1口当たり分配金額	I=F/H	105円	項目			当期配当等収益額	A	136,019,250円	分配準備積立金額	B	508,083円	配当等収益合計額	C=A+B	136,527,333円	経費	D	10,446,241円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	126,081,092円	収益分配金金額	F	125,673,024円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	408,068円	当ファンドの期末残存口数	H	1,309,094口	1口当たり分配金額	I=F/H	96円
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	103,316,648円																																																																																																																							
分配準備積立金額	B	639,921円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	103,956,569円																																																																																																																							
経費	D	8,817,489円																																																																																																																							
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	95,139,080円																																																																																																																							
収益分配金金額	F	94,443,895円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	695,185円																																																																																																																							
当ファンドの期末残存口数	H	1,037,845口																																																																																																																							
1口当たり分配金額	I=F/H	91円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	111,274,414円																																																																																																																							
分配準備積立金額	B	695,185円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	111,969,599円																																																																																																																							
経費	D	9,996,741円																																																																																																																							
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	101,972,858円																																																																																																																							
収益分配金金額	F	101,008,180円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	964,678円																																																																																																																							
当ファンドの期末残存口数	H	1,097,915口																																																																																																																							
1口当たり分配金額	I=F/H	92円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	134,871,399円																																																																																																																							
分配準備積立金額	B	964,678円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	135,836,077円																																																																																																																							
経費	D	11,622,139円																																																																																																																							
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	124,213,938円																																																																																																																							
収益分配金金額	F	123,705,855円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	508,083円																																																																																																																							
当ファンドの期末残存口数	H	1,178,151口																																																																																																																							
1口当たり分配金額	I=F/H	105円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
当期配当等収益額	A	136,019,250円																																																																																																																							
分配準備積立金額	B	508,083円																																																																																																																							
配当等収益合計額	C=A+B	136,527,333円																																																																																																																							
経費	D	10,446,241円																																																																																																																							
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	126,081,092円																																																																																																																							
収益分配金金額	F	125,673,024円																																																																																																																							
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	408,068円																																																																																																																							
当ファンドの期末残存口数	H	1,309,094口																																																																																																																							
1口当たり分配金額	I=F/H	96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31年4月11日 至令和1年10月10日	当期 自令和1年10月11日 至令和2年4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 [令和1年10月10日現在]	当期 [令和2年4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	同左

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10月10日現在]	当期 [令和2年4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	1,314,293,999	△3,742,984,066
合計	1,314,293,999	△3,742,984,066

(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10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	163,912,500	—	170,670,500	6,758,000
合計		163,912,500	—	170,670,500	6,758,000

当期 [令和2年4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	323,949,670	—	286,161,000	△37,788,670
合計		323,949,670	—	286,161,000	△37,788,670

(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)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	前期 [令和1年10月10日現在]	当期 [令和2年4月10日現在]
1口当たり純資産額	11,938円	7,865円