

令和2年10月期（令和2年4月11日～令和2年10月10日）決算短信

令和2年11月16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3年1月8日
 分配金支払開始予定日 令和2年11月18日

I ファンドの運用状況

1. 令和2年10月期の運用状況（令和2年4月11日～令和2年10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10月期	13,092	(97.5)	334	(2.5)	13,426	(100.0)
令和2年4月期	10,008	(97.2)	287	(2.8)	10,295	(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10月期	1,309	110	—	1,419
令和2年4月期	1,097	309	98	1,309

(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10月期	13,606	180	13,426	9,461
令和2年4月期	10,470	175	10,295	7,865

(4) 分配金

	1口当たり分配金
	円
令和2年10月期	191
令和2年4月期	201

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 4 月 10 日現在]	当期 [令和 2 年 10 月 10 日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	115,549,008	107,865,526
投資証券	10,008,207,520	13,092,349,400
派生商品評価勘定	1,434,370	2,876,790
未収入金	127,870,900	165,307,387
未収配当金	130,794,384	165,293,251
前払金	37,602,670	-
差入委託証拠金	49,476,000	73,235,000
流動資産合計	10,470,934,852	13,606,927,354
資産合計	10,470,934,852	13,606,927,354
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	39,227,110	-
前受金	-	4,719,900
未払収益分配金	125,673,024	164,621,748
未払受託者報酬	1,311,315	1,406,764
未払委託者報酬	6,884,367	7,385,477
未払利息	104	42
その他未払費用	2,093,464	2,219,453
流動負債合計	175,189,384	180,353,384
負債合計	175,189,384	180,353,384
純資産の部		
元本等		
元本	11,366,863,202	12,322,505,499
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△1,071,117,734	1,104,068,471
(分配準備積立金)	408,068	1,183,903
元本等合計	10,295,745,468	13,426,573,970
純資産合計	10,295,745,468	13,426,573,970
負債純資産合計	10,470,934,852	13,606,927,354

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期	当期
	自 令和1年10月11日 至 令和2年4月10日	自 令和2年4月11日 至 令和2年10月10日
営業収益		
受取配当金	270,913,105	289,488,400
受取利息	449	617
有価証券売買等損益	△4,589,927,315	2,123,452,470
派生商品取引等損益	△93,889,640	37,147,860
その他収益	3	3
営業収益合計	△4,412,903,398	2,450,089,350
営業費用		
支払利息	22,908	34,521
受託者報酬	2,785,435	2,670,356
委託者報酬	14,623,491	14,019,285
その他費用	4,659,454	4,674,275
営業費用合計	22,091,288	21,398,437
営業利益又は営業損失(△)	△4,434,994,686	2,428,690,913
経常利益又は経常損失(△)	△4,434,994,686	2,428,690,913
当期純利益又は当期純損失(△)	△4,434,994,686	2,428,690,913
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(△)	3,573,680,036	△1,071,117,734
剰余金増加額又は欠損金減少額	290,514,339	22,673,606
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	290,514,339	22,673,606
剰余金減少額又は欠損金増加額	250,938,544	8,863,566
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	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	8,863,566
分配金	249,378,879	267,314,748
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△1,071,117,734	1,104,068,471

(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4月10日現在]	当期 [令和2年10月10日現在]
1. 期首元本額	9,533,195,945 円	11,366,863,202 円
期中追加設定元本額	2,686,337,857 円	955,642,297 円
期中一部交換元本額	852,670,600 円	— 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。	1,071,117,734 円	— 円
3. 受益権の総数	1,309,094 口	1,419,153 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 令和1年10月11日 至 令和2年4月10日			当期 自 令和2年4月11日 至 令和2年10月10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			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			第11期 令和2年4月11日 令和2年7月10日		
項目			項目		
当期配当等収益額	A	134,871,399 円	当期配当等収益額	A	112,729,370 円
分配準備積立金額	B	964,678 円	分配準備積立金額	B	408,068 円
配当等収益合計額	C=A+B	135,836,077 円	配当等収益合計額	C=A+B	113,137,438 円
経費	D	11,622,139 円	経費	D	10,130,266 円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	124,213,938 円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	103,007,172 円
収益分配金金額	F	123,705,855 円	収益分配金金額	F	102,693,000 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	508,083 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	314,172 円
当ファンドの期末残存口数	H	1,178,151 口	当ファンドの期末残存口数	H	1,369,240 口
1口当たり分配金額	I=F/H	105 円	1口当たり分配金額	I=F/H	75 円
第10期 令和2年1月11日 令和2年4月10日			第12期 令和2年7月11日 令和2年10月10日		
項目			項目		
当期配当等収益額	A	136,019,250 円	当期配当等収益額	A	176,725,129 円
分配準備積立金額	B	508,083 円	分配準備積立金額	B	314,172 円
配当等収益合計額	C=A+B	136,527,333 円	配当等収益合計額	C=A+B	177,039,301 円
経費	D	10,446,241 円	経費	D	11,233,650 円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	126,081,092 円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	165,805,651 円
収益分配金金額	F	125,673,024 円	収益分配金金額	F	164,621,748 円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	408,068 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,183,903 円
当ファンドの期末残存口数	H	1,309,094 口	当ファンドの期末残存口数	H	1,419,153 口
1口当たり分配金額	I=F/H	96 円	1口当たり分配金額	I=F/H	116 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 10 月 11 日 至 令和 2 年 4 月 10 日	当期 自 令和 2 年 4 月 11 日 至 令和 2 年 10 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 2 年 4 月 10 日現在]	当期 [令和 2 年 10 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2年4月10日現在]	当期 [令和2年10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	△3,742,984,066	749,328,585
合計	△3,742,984,066	749,328,585

(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

当期 [令和2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	330,997,100	—	333,874,000	2,876,900
合計		330,997,100	—	333,874,000	2,876,900

(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2年4月10日現在]	当期 [令和2年10月10日現在]
1口当たり純資産額	7,865円	9,461円