

2024年6月期（2023年12月9日～2024年6月8日）決算短信

2024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 岩瀬 直美 TEL (03)4223-3038

有価証券報告書提出予定日 2024年9月6日
 分配金支払開始予定日 2024年7月17日

I ファンドの運用状況

1. 2024年6月期の運用状況（2023年12月9日～2024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	%
2024年6月期	203,198	(98.8)	2,423	(1.2)	205,622	(100.0)
2023年12月期	183,911	(98.6)	2,573	(1.4)	186,484	(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
2024年6月期	100,581	19,989	4,040	116,530
2023年12月期	94,634	9,091	3,144	100,581

(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
2024年6月期	246,093	40,471	205,622	176,454
2023年12月期	219,388	32,904	186,484	185,406

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
2024年6月期	378
2023年12月期	373

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12月8日現在]	当期 [2024年6月8日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	34,007,984,244	41,112,000,954
投資証券	183,911,358,200	203,198,970,550
派生商品評価勘定	-	47,362,170
未収入金	79,902,700	27,950,440
未収配当金	1,100,632,998	1,429,915,400
未収利息	104,059	144,624
前払金	10,624,000	-
その他未収収益	69,007,181	57,927,373
差入委託証拠金	209,060,703	219,290,456
流動資産合計	219,388,674,085	246,093,561,967
資産合計	219,388,674,085	246,093,561,967
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,879,410	869,820
前受金	-	116,581,000
未払金	3,031,960	-
未払収益分配金	1,176,804,544	1,410,014,379
未払受託者報酬	20,447,387	22,257,707
未払委託者報酬	58,731,477	65,072,966
未払利息	8,497	3,459,411
受入担保金	31,623,070,605	38,834,795,685
その他未払費用	16,271,008	18,346,850
流動負債合計	32,904,244,888	40,471,397,818
負債合計	32,904,244,888	40,471,397,818
純資産の部		
元本等		
元本	150,168,306,405	173,979,460,202
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	36,316,122,792	31,642,703,947
(分配準備積立金)	595,919	10,070,214
元本等合計	186,484,429,197	205,622,164,149
純資産合計	186,484,429,197	205,622,164,149
負債純資産合計	219,388,674,085	246,093,561,967

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期		当期	
	自 2023年6月9日 至 2023年12月8日		自 2023年12月9日 至 2024年6月8日	
営業収益				
受取配当金		3,656,296,411		4,300,639,295
受取利息		8,876,496		6,327,829
有価証券売買等損益		△4,057,856,216		△9,496,010,745
派生商品取引等損益		△8,988,190		△51,803,430
その他収益		219,964,680		164,996,178
営業収益合計		△181,706,819		△5,075,850,873
営業費用				
支払利息		10,840,814		6,591,391
受託者報酬		41,562,088		42,683,598
委託者報酬		118,673,932		124,368,551
その他費用		33,520,861		35,863,499
営業費用合計		204,597,695		209,507,039
営業利益又は営業損失(△)		△386,304,514		△5,285,357,912
経常利益又は経常損失(△)		△386,304,514		△5,285,357,912
当期純利益又は当期純損失(△)		△386,304,514		△5,285,357,912
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(△)		38,034,127,528		36,316,122,792
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,684,503,205		6,236,134,432
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,684,503,205		6,236,134,432
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,331,053,642		1,371,213,397
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,331,053,642		1,371,213,397
分配金		3,685,149,785		4,252,981,968
期末剰余金又は期末欠損金(△)		36,316,122,792		31,642,703,947

(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12月8日現在]	当期 [2024年6月8日現在]
1. 期首元本額	141,289,593,663円	150,168,306,405円
期中追加設定元本額	13,573,460,200円	29,844,323,500円
期中一部交換元本額	4,694,747,458円	6,033,169,703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	29,834,756,300円	36,659,075,550円
3. 受益権の総数	100,581,585口	116,530,114口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2023年6月9日 至 2023年12月8日	当期 自 2023年12月9日 至 2024年6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 第39期 2023年6月9日 2023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>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> <p>第40期 2023年9月9日 2023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>1,271,849,591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	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	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	<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41期 2023年12月9日 2024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>2,948,210,942円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>595,919円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>2,948,806,861円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>96,610,452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>2,852,196,409円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>2,842,967,589円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>9,228,820円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>110,621,307口</td> </tr> <tr> <td>100口当たり分配金額</td> <td>I=F/H*100</td> <td>2,570円</td> </tr> </tbody> </table> <p>第42期 2024年3月9日 2024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>1,517,160,969円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>9,228,820円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>1,526,389,789円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	2,948,210,942円	分配準備積立金額	B	595,919円	配当等収益合計額	C=A+B	2,948,806,861円	経費	D	96,610,452円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	2,852,196,409円	収益分配金金額	F	2,842,967,589円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	9,228,820円	当ファンドの期末残存口数	H	110,621,307口	100口当たり分配金額	I=F/H*100	2,570円	項目			当期配当等収益額	A	1,517,160,969円	分配準備積立金額	B	9,228,820円	配当等収益合計額	C=A+B	1,526,389,789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																																																																																			
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	2,948,210,942円																																																																																			
分配準備積立金額	B	595,919円																																																																																			
配当等収益合計額	C=A+B	2,948,806,861円																																																																																			
経費	D	96,610,452円																																																																																			
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	2,852,196,409円																																																																																			
収益分配金金額	F	2,842,967,589円																																																																																			
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	9,228,820円																																																																																			
当ファンドの期末残存口数	H	110,621,307口																																																																																			
100口当たり分配金額	I=F/H*100	2,570円																																																																																			
項目																																																																																					
当期配当等収益額	A	1,517,160,969円																																																																																			
分配準備積立金額	B	9,228,820円																																																																																			
配当等収益合計額	C=A+B	1,526,389,789円																																																																																			

経費	D	95,858,205円	経費	D	106,305,196円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	1,177,400,463円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	1,420,084,593円
収益分配金金額	F	1,176,804,544円	収益分配金金額	F	1,410,014,379円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	595,919円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	10,070,214円
当ファンドの期末残存口数	H	100,581,585口	当ファンドの期末残存口数	H	116,530,114口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,170円	100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,210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 2023年6月9日 至 2023年12月8日	当期 自 2023年12月9日 至 2024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12月8日現在]	当期 [2024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。 (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12月8日現在]	当期 [2024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	△8,725,201,472	4,177,761,272
合計	△8,725,201,472	4,177,761,272

(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

当期 [2024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	2,379,174,000	—	2,425,668,000	46,494,000
合計		2,379,174,000	—	2,425,668,000	46,494,000

(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 2023年6月9日 至 2023年12月8日	当期 自 2023年12月9日 至 2024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	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 1,337,526円 利息の受取 793,224円	有価証券の貸付 1円 品貸料の受取 1,062,127円 利息の支払 773,623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 2,075,603,355円 その他未収収益 23,526円 未収利息 4,158円	受入担保金 8,461,884,690円 その他未収収益 141,585円 未払利息 143,285円

	前期 自 2023年6月9日 至 2023年12月8日	当期 自 2023年12月9日 至 2024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	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 202,057円 利息の受取 54,218円	有価証券の貸付 1円 品貸料の受取 646,433円 利息の支払 135,718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 556,689,105円 その他未収収益 21,357円 未収利息 2,002円	受入担保金 483,857,220円 その他未収収益 10,580円 未払利息 8,163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12月8日現在]	当期 [2024年6月8日現在]
1口当たり純資産額	1,854.06円	1,764.54円
(100口当たり純資産額)	(185,406円)	(176,454円)