

# 平成29年6月期（平成28年12月9日～平成29年6月8日）決算短信

平成29年7月13日

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  
 代表者名 取締役社長 松田 通  
 問合せ先責任者 ディスクロージャー部 宇野 誠朗

上場取引所 東証

URL <http://www.am.mufg.jp/>

TEL (03)6250-4910

有価証券報告書提出予定日 平成29年 9月 7日  
 分配金支払開始予定日 平成29年 7月 14日

## I ファンドの運用状況

### 1. 平成29年6月期の運用状況（平成28年12月9日～平成29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	%
平成29年6月期	74,596	( 98.6 )	1,081	( 1.4 )	75,678	( 100.0 )
平成28年12月期	64,878	( 98.8 )	809	( 1.2 )	65,688	( 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
平成29年6月期	36,080	10,066	3,254	42,892
平成28年12月期	24,829	11,989	738	36,080

#### (3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	10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
平成29年6月期	104,416	28,738	75,678	176,435
平成28年12月期	66,080	392	65,688	182,059

#### (4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
平成29年6月期	302
平成28年12月期	251

### 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【財務諸表】

## 【MAXIS Jリート上場投信】

## (1)【貸借対照表】

	前期	当期
	[平成28年12月8日現在]	[平成29年6月8日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	423,780,576	28,903,420,029
投資証券 ※2	64,878,931,600	74,596,887,500
派生商品評価勘定	9,436,160	—
未収入金	344,948,000	417,964,600
未収配当金	384,508,955	460,966,340
前払金	—	6,158,000
その他未収収益	—	7,946,579
差入委託証拠金	38,590,000	23,273,000
流動資産合計	66,080,195,291	104,416,616,048
資産合計	66,080,195,291	104,416,616,048
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	17,154,932
前受金	3,307,700	—
未払金	—	15,432
未払収益分配金	342,767,429	420,351,302
未払受託者報酬	6,422,364	9,398,211
未払委託者報酬	33,717,396	42,088,069
未払利息	655	50,497
受入担保金	—	28,241,955,000
その他未払費用	5,794,820	7,423,572
流動負債合計	392,010,364	28,738,437,015
負債合計	392,010,364	28,738,437,015
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	53,868,607,526	64,039,234,070
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	11,819,577,401	11,638,944,963
(分配準備積立金)	(3,511,394)	(3,502,653)
元本等合計	65,688,184,927	75,678,179,033
純資産合計	65,688,184,927	75,678,179,033
負債純資産合計	66,080,195,291	104,416,616,048

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

	前期	当期
	自平成28年6月9日 至平成28年12月8日	自平成28年12月9日 至平成29年6月8日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取配当金	878,007,473	1,283,580,359
受取利息	1,475	23,957
有価証券売買等損益	△1,900,870,778	△2,224,505,577
派生商品取引等損益	△21,981,376	△16,224,184
その他収益	19,111,551	12,015,499
営業収益合計	△1,025,731,655	△945,109,946
営業費用		
支払利息	127,754	3,424,574
受託者報酬	11,767,374	16,656,819
委託者報酬	61,778,691	79,713,355
その他費用 ※1	11,345,866	14,173,234
営業費用合計	85,019,685	113,967,982
営業利益又は営業損失(△)	△1,110,751,340	△1,059,077,928
経常利益又は経常損失(△)	△1,110,751,340	△1,059,077,928
当期純利益又は当期純損失(△)	△1,110,751,340	△1,059,077,928
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(△)	10,047,038,584	11,819,577,401
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,991,850,326	3,187,988,458
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損 金減少額	3,991,850,326	3,187,988,458
剰余金減少額又は欠損金増加額	299,056,621	1,127,882,394
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損 金増加額	299,056,621	1,127,882,394
分配金 ※2	809,503,548	1,181,660,574
期末剰余金又は期末欠損金(△)	11,819,577,401	11,638,944,963

## (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 [平成28年12月8日現在]	当期 [平成29年6月8日現在]
※1 期首元本額	37,070,869,005円	53,868,607,526円
期中追加設定元本額	17,900,771,400円	15,029,284,500円
期中一部交換元本額	1,103,032,879円	4,858,657,956円
※2 貸付有価証券 投資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	—	26,761,260,000円
3 受益権の総数	36,080,782口	42,892,990口
4 1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	1,820.59円 (182,059円)	1,764.35円 (176,435円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期(自平成28年6月9日 至平成28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。

※2 分配金の計算過程

(自平成28年6月9日 至平成28年9月8日)		
当期配当等収益額	A	505,547,934円
分配準備積立金額	B	914,128円
配当等収益合計額	C=A+B	506,462,062円
経費	D	38,723,434円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	467,738,628円
収益分配金金額	F	466,736,119円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,002,509円
当ファンドの期末残存口数	H	29,918,982口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,560円

(自平成28年9月9日 至平成28年12月8日)		
当期配当等収益額	A	391,444,811円
分配準備積立金額	B	1,002,509円
配当等収益合計額	C=A+B	392,447,320円
経費	D	46,168,497円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	346,278,823円
収益分配金金額	F	342,767,429円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	3,511,394円
当ファンドの期末残存口数	H	36,080,782口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	950円

当期(自平成28年12月9日 至平成29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。

※2 分配金の計算過程

(自平成28年12月9日 至平成29年3月8日)		
当期配当等収益額	A	810,227,504円
分配準備積立金額	B	3,511,394円
配当等収益合計額	C=A+B	813,738,898円
経費	D	51,383,389円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	762,355,509円
収益分配金金額	F	761,309,272円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	1,046,237円
当ファンドの期末残存口数	H	37,319,082口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	2,040円

（自平成29年3月9日 至平成29年6月8日）		
当期配当等収益額	A	481,967,737円
分配準備積立金額	B	1,046,237円
配当等収益合計額	C=A+B	483,013,974円
経費	D	59,160,019円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	423,853,955円
収益分配金金額	F	420,351,302円
次期繰越金（分配準備積立金）	G=E-F	3,502,653円
当ファンドの期末残存口数	H	42,892,990口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	980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28年6月9日 至平成28年12月8日）	当期 （自平成28年12月9日 至平成29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。	同 左 同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	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。 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、運用部門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 [平成28年12月8日現在]	当期 [平成29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	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。 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 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	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。 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 [平成28年12月8日現在]	当期 [平成29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	△680,766,834	△1,594,352,058
合計	△680,766,834	△1,594,352,058

(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

区 分	種 類	前期 [ 平成28年12月8日現在 ]			
		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	798,456,300	—	807,893,000	9,436,700
	合 計	798,456,300	—	807,893,000	9,436,700

区 分	種 類	当期 [ 平成29年6月8日現在 ]			
		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	1,098,416,000	—	1,081,261,500	△17,154,500
	合 計	1,098,416,000	—	1,081,261,500	△17,154,500

(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。