

2024年5月期（2023年11月11日～2024年5月10日）決算短信

2024年6月17日
上場取引所 東証

ファンド名 MAXIS Jリート・コア上場投信
 コード番号 2517
 連動対象指標 東証REIT Core 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 笠間 悦男 TEL (03)4223-3038

有価証券報告書提出予定日 2024年8月9日
 分配金支払開始予定日 2024年6月18日

I ファンドの運用状況

1. 2024年5月期の運用状況（2023年11月11日～2024年5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	%
2024年5月期	59,047	(98.0)	1,180	(2.0)	60,227	(100.0)
2023年11月期	48,141	(98.1)	955	(1.9)	49,097	(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5月期	45,277	15,633	5,497	55,413
2023年11月期	41,809	3,956	489	45,277

(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5月期	60,862	634	60,227	108,689
2023年11月期	49,601	504	49,097	108,437

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
2024年5月期	224
2023年11月期	203

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11月10日現在]	当期 [2024年5月10日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	466,869,077	601,642,475
投資証券	48,141,541,600	59,047,651,800
派生商品評価勘定	-	72,823,780
未収入金	430,318,835	524,403,697
未収配当金	456,073,075	546,455,874
未収利息	-	1,054
前払金	51,207,200	-
差入委託証拠金	55,748,657	69,868,304
流動資産合計	49,601,758,444	60,862,846,984
資産合計	49,601,758,444	60,862,846,984
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	46,181,700	-
前受金	-	82,634,000
未払収益分配金	430,132,963	520,884,239
未払受託者報酬	3,432,970	3,806,145
未払委託者報酬	16,478,211	18,269,431
未払利息	245	-
その他未払費用	8,128,396	9,341,095
流動負債合計	504,354,485	634,934,910
負債合計	504,354,485	634,934,910
純資産の部		
元本等		
元本	44,733,828,152	54,748,258,396
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	4,363,575,807	5,479,653,678
(分配準備積立金)	4,430,176	4,360,068
元本等合計	49,097,403,959	60,227,912,074
純資産合計	49,097,403,959	60,227,912,074
負債純資産合計	49,601,758,444	60,862,846,984

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期		当期	
	自 2023年5月11日 至 2023年11月10日		自 2023年11月11日 至 2024年5月10日	
営業収益				
受取配当金		965,706,578		1,243,046,005
受取利息		3,055		51,373
有価証券売買等損益		△1,400,647,055		311,857,537
派生商品取引等損益		△10,043,660		33,435,930
その他収益		11,302		-
営業収益合計		△444,969,780		1,588,390,845
営業費用				
支払利息		158,122		24,071
受託者報酬		6,703,470		7,390,385
委託者報酬		32,176,576		35,473,749
その他費用		16,056,084		17,949,075
営業費用合計		55,094,252		60,837,280
営業利益又は営業損失(△)		△500,064,032		1,527,553,565
経常利益又は経常損失(△)		△500,064,032		1,527,553,565
当期純利益又は当期純損失(△)		△500,064,032		1,527,553,565
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(△)		5,304,466,490		4,363,575,807
剰余金増加額又は欠損金減少額		535,428,999		1,251,349,056
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		535,428,999		1,251,349,056
剰余金減少額又は欠損金増加額		69,364,960		480,494,544
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		69,364,960		480,494,544
分配金		906,890,690		1,182,330,206
期末剰余金又は期末欠損金(△)		4,363,575,807		5,479,653,678

(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11月10日現在]	当期 [2024年5月10日現在]
1. 期首元本額	41,308,115,992円	44,733,828,152円
期中追加設定元本額	3,909,022,000円	15,445,601,600円
期中一部交換元本額	483,309,840円	5,431,171,356円
2. 受益権の総数	45,277,154口	55,413,217口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自2023年5月11日 至2023年11月10日	当期 自2023年11月11日 至2024年5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21期 2023年5月11日 2023年8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>505,706,035円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金額</td><td>B</td><td>694,183円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>506,400,218円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>26,823,909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>479,576,309円</td></tr> <tr><td>収益分配金金額</td><td>F</td><td>476,757,727円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>2,818,582円</td></tr> <tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>H</td><td>44,144,234口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金額</td><td>I=F/H*100</td><td>1,080円</td></tr> </tbody> </table> <p>第22期 2023年8月11日 2023年11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>459,856,778円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金額</td><td>B</td><td>2,818,582円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>462,675,360円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>28,112,221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>434,563,139円</td></tr> <tr><td>収益分配金金額</td><td>F</td><td>430,132,963円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>4,430,176円</td></tr> <tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>H</td><td>45,277,154口</td></tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	505,706,035円	分配準備積立金額	B	694,183円	配当等収益合計額	C=A+B	506,400,218円	経費	D	26,823,909円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	479,576,309円	収益分配金金額	F	476,757,727円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,818,582円	当ファンドの期末残存口数	H	44,144,234口	100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,080円	項目			当期配当等収益額	A	459,856,778円	分配準備積立金額	B	2,818,582円	配当等収益合計額	C=A+B	462,675,360円	経費	D	28,112,221円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	434,563,139円	収益分配金金額	F	430,132,963円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	4,430,176円	当ファンドの期末残存口数	H	45,277,154口	<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23期 2023年11月11日 2024年2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>691,379,358円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金額</td><td>B</td><td>4,430,176円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>695,809,534円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>29,289,881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>666,519,653円</td></tr> <tr><td>収益分配金金額</td><td>F</td><td>661,445,967円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>5,073,686円</td></tr> <tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>H</td><td>50,880,459口</td></tr> <tr><td>100口当たり分配金額</td><td>I=F/H*100</td><td>1,300円</td></tr> </tbody> </table> <p>第24期 2024年2月11日 2024年5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>551,693,949円</td></tr> <tr><td>分配準備積立金額</td><td>B</td><td>5,073,686円</td></tr> <tr><td>配当等収益合計額</td><td>C=A+B</td><td>556,767,635円</td></tr> <tr><td>経費</td><td>D</td><td>31,523,328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>525,244,307円</td></tr> <tr><td>収益分配金金額</td><td>F</td><td>520,884,239円</td></tr> <tr><td>次期繰越金(分配準備積立金)</td><td>G=E-F</td><td>4,360,068円</td></tr> <tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>H</td><td>55,413,217口</td></tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	691,379,358円	分配準備積立金額	B	4,430,176円	配当等収益合計額	C=A+B	695,809,534円	経費	D	29,289,881円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	666,519,653円	収益分配金金額	F	661,445,967円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	5,073,686円	当ファンドの期末残存口数	H	50,880,459口	100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,300円	項目			当期配当等収益額	A	551,693,949円	分配準備積立金額	B	5,073,686円	配当等収益合計額	C=A+B	556,767,635円	経費	D	31,523,328円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	525,244,307円	収益分配金金額	F	520,884,239円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	4,360,068円	当ファンドの期末残存口数	H	55,413,217口
項目																																																																																																																			
当期配当等収益額	A	505,706,035円																																																																																																																	
分配準備積立金額	B	694,183円																																																																																																																	
配当等収益合計額	C=A+B	506,400,218円																																																																																																																	
経費	D	26,823,909円																																																																																																																	
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	479,576,309円																																																																																																																	
収益分配金金額	F	476,757,727円																																																																																																																	
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	2,818,582円																																																																																																																	
当ファンドの期末残存口数	H	44,144,234口																																																																																																																	
100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,080円																																																																																																																	
項目																																																																																																																			
当期配当等収益額	A	459,856,778円																																																																																																																	
分配準備積立金額	B	2,818,582円																																																																																																																	
配当等収益合計額	C=A+B	462,675,360円																																																																																																																	
経費	D	28,112,221円																																																																																																																	
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	434,563,139円																																																																																																																	
収益分配金金額	F	430,132,963円																																																																																																																	
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	4,430,176円																																																																																																																	
当ファンドの期末残存口数	H	45,277,154口																																																																																																																	
項目																																																																																																																			
当期配当等収益額	A	691,379,358円																																																																																																																	
分配準備積立金額	B	4,430,176円																																																																																																																	
配当等収益合計額	C=A+B	695,809,534円																																																																																																																	
経費	D	29,289,881円																																																																																																																	
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	666,519,653円																																																																																																																	
収益分配金金額	F	661,445,967円																																																																																																																	
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	5,073,686円																																																																																																																	
当ファンドの期末残存口数	H	50,880,459口																																																																																																																	
100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,300円																																																																																																																	
項目																																																																																																																			
当期配当等収益額	A	551,693,949円																																																																																																																	
分配準備積立金額	B	5,073,686円																																																																																																																	
配当等収益合計額	C=A+B	556,767,635円																																																																																																																	
経費	D	31,523,328円																																																																																																																	
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	525,244,307円																																																																																																																	
収益分配金金額	F	520,884,239円																																																																																																																	
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	4,360,068円																																																																																																																	
当ファンドの期末残存口数	H	55,413,217口																																																																																																																	

100口当たり分配金額	I=F/H*100	950円	100口当たり分配金額	I=F/H*100	940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 5月 11日 至 2023年 11月 10日	当期 自 2023年 11月 11日 至 2024年 5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 11月 10日現在]	当期 [2024年 5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	同左

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 [2023年11月10日現在]	当期 [2024年5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	△2,062,701,507	1,858,898,888
合計	△2,062,701,507	1,858,898,888

(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11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	1,002,613,700	—	956,432,000	△46,181,700
合計		1,002,613,700	—	956,432,000	△46,181,700

当期 [2024年5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	1,105,357,000	—	1,178,181,000	72,824,000
合計		1,105,357,000	—	1,178,181,000	72,824,000

(注) 時価の算定方法

- 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。
- 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 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 [2023年11月10日現在]	当期 [2024年5月10日現在]
1口当たり純資産額	1,084.37円	1,086.89円
(100口当たり純資産額)	(108,437円)	(108,689円)