

2020年10月期 決算短信 (2020年4月16日～2020年10月15日)

2020年11月24日

ファンド名	NZAM 上場投信 東証REIT指数	上場取引所	東証
コード番号	1595	売買単位	10口
連動対象指標	東証REIT指数		
主要投資資産	投資証券		
管理会社	農林中金全共連アセットマネジメント株式会社		
URL	https://www.ja-asset.co.jp/		
代表者	代表取締役社長	吉田 一生	
問合せ先責任者	企画部 ディスクロージャーグループ	田原 輝行	(TEL) 03-5210-8779
有価証券報告書提出予定日	2021年1月15日		
分配金支払開始予定日	2020年11月20日		

I ファンドの運用状況

1. 2020年10月期の運用状況 (2020年4月16日～2020年10月15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	%
2020年10月期	176,743	(96.2)	6,960	(3.8)	183,704	(100.0)
2020年4月期	158,727	(96.7)	5,436	(3.3)	164,164	(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
2020年10月期	105,493	8,705	7,981	106,217
2020年4月期	98,921	19,043	12,472	105,493

(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
2020年10月期	186,065	2,360	183,704	172,951
2020年4月期	167,618	3,454	164,164	155,615

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
2020年10月期	202
2020年4月期	190

(注) 分配金は売買単位当たりの金額

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

NZAM 上場投信 東証 REIT 指数

(1) 【貸借対照表】

	前期 2020年4月15日現在	当期 2020年10月15日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,350,883,196	5,351,688,775
投資証券	158,727,750,240	176,743,851,350
未収入金	-	10,861,996
未収配当金	1,938,483,998	2,012,904,539
前払金	1,238,475,800	16,150,800
差入委託証拠金	1,362,880,500	1,930,110,000
流動資産合計	167,618,473,734	186,065,567,460
資産合計	167,618,473,734	186,065,567,460
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	817,625,854	59,322,344
未払金	478,171,200	11,992,500
未払収益分配金	2,004,378,571	2,145,598,004
未払受託者報酬	20,764,981	19,319,975
未払委託者報酬	114,753,791	106,768,257
未払利息	2,302	2,696
その他未払費用	18,429,487	17,794,393
流動負債合計	3,454,126,186	2,360,798,169
負債合計	3,454,126,186	2,360,798,169
純資産の部		
元本等		
元本	156,658,009,365	157,733,318,655
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	7,506,338,183	25,971,450,636
(分配準備積立金)	4,314,238	3,149,792
元本等合計	164,164,347,548	183,704,769,291
純資産合計	164,164,347,548	183,704,769,291
負債純資産合計	167,618,473,734	186,065,567,460

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	前期	当期
	自 2019年10月16日 至 2020年4月15日	自 2020年4月16日 至 2020年10月15日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	4,035,854,197	3,826,053,282
受取利息	3,577	36,516
有価証券売買等損益	△67,211,401,212	17,560,093,163
派生商品取引等損益	△2,182,424,858	676,267,234
その他収益	53	10,862,036
営業収益合計	△65,357,968,243	22,073,312,231
営業費用		
支払利息	957,526	1,065,829
受託者報酬	44,152,921	37,760,269
委託者報酬	244,002,903	208,675,121
その他費用	37,242,297	35,134,522
営業費用合計	326,355,647	282,635,741
営業利益又は営業損失 (△)	△65,684,323,890	21,790,676,490
経常利益又は経常損失 (△)	△65,684,323,890	21,790,676,490
当期純利益又は当期純損失 (△)	△65,684,323,890	21,790,676,490
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 (△)	75,630,955,548	7,506,338,183
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,566,862,926	2,194,032,122
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,566,862,926	2,194,032,122
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,298,534,750	1,964,115,620
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,298,534,750	1,964,115,620
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	3,708,621,651	3,555,480,539
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	7,506,338,183	25,971,450,636

(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 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として特定期間末日に知り得る直近の日の主たる取引所の発表する清算値段、又は最終相場に基づいて評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目		前期 2020年4月15日現在	当期 2020年10月15日現在
1.	投資信託財産に係る元本の状況		
	期首元本額	146,899,150,695 円	156,658,009,365 円
	期中追加設定元本額	28,280,191,500 円	12,927,667,500 円
	期中一部交換元本額	18,521,332,830 円	11,852,358,210 円
2.	特定期間の末日における受益権の総数	105,493,609 口	106,217,723 口
3.	1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	1,556.15 円 (155,615 円)	1,729.51 円 (172,951 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期		当期	
	自 2019年10月16日 至 2020年4月15日		自 2020年4月16日 至 2020年10月15日	
分配金の計算過程	第23期		第25期	
	自 2019年10月16日 至 2020年1月15日		自 2020年4月16日 至 2020年7月15日	
	A. 配当等収益額	1,879,632,909 円	A. 配当等収益額	1,546,654,719 円
	B. 分配準備積立金額	3,433,709 円	B. 分配準備積立金額	4,314,238 円
	C. 配当等収益合計額 (A+B)	1,883,066,618 円	C. 配当等収益合計額 (A+B)	1,550,968,957 円
	D. 経費	171,388,015 円	D. 経費	137,631,906 円
	E. 収益分配可能額 (C-D)	1,711,678,603 円	E. 収益分配可能額 (C-D)	1,413,337,051 円
	F. 収益分配金	1,704,243,080 円	F. 収益分配金	1,409,882,535 円
	G. 次期繰越金(分配準備積立金)(E-F)	7,435,523 円	G. 次期繰越金(分配準備積立金)(E-F)	3,454,516 円
	H. 口数	103,917,261 口	H. 口数	106,809,283 口
	I. 100口当たり分配金 (F/H×100)	1,640 円	I. 100口当たり分配金 (F/H×100)	1,320 円
	第24期		第26期	
	自 2020年1月16日 至 2020年4月15日		自 2020年7月16日 至 2020年10月15日	
	A. 配当等収益額	2,155,267,392 円	A. 配当等収益額	2,289,231,286 円
	B. 分配準備積立金額	7,435,523 円	B. 分配準備積立金額	3,454,516 円
	C. 配当等収益合計額 (A+B)	2,162,702,915 円	C. 配当等収益合計額 (A+B)	2,292,685,802 円
	D. 経費	154,010,106 円	D. 経費	143,938,006 円
	E. 収益分配可能額 (C-D)	2,008,692,809 円	E. 収益分配可能額 (C-D)	2,148,747,796 円
	F. 収益分配金	2,004,378,571 円	F. 収益分配金	2,145,598,004 円
	G. 次期繰越金(分配準備積立金)(E-F)	4,314,238 円	G. 次期繰越金(分配準備積立金)(E-F)	3,149,792 円
	H. 口数	105,493,609 口	H. 口数	106,217,723 口
	I. 100口当たり分配金 (F/H×100)	1,900 円	I. 100口当たり分配金 (F/H×100)	2,020 円

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

項目	前期 自 2019年10月16日 至 2020年4月15日	当期 自 2020年4月16日 至 2020年10月15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第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権等であります。 当ファンドが保有する有価証券は、全て売買目的で保有しており、デリバティブ取引は、ヘッジ目的以外にも利用する場合があります。また、これらの詳細は、「(重要な会計方針に係る事項に関する注記) 有価証券の評価基準及び評価方法、デリバティブ等の評価基準及び評価方法」に記載しております。 当該金融商品は、金利変動リスク、信用リスク、流動性リスク、価格変動リスク等に晒されています。	同左
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	フロント部門では、ポジションリスク管理及びパフォーマンス管理を行っています。また、決定された運用計画に基づいた運用（あるいはポジション組成）となっているか管理を行っています。 ミドル部門は、ファンド運用状況の日々のモニタリングや定期的なフィードバックを行ないフロント部門を牽制しております。法令等のルールや組織的に決定された運用計画に従って運用されるよう、日常的な管理を行うほか、運用管理会議を開催してこれらの遵守状況を検証しております。また、各種運用リスクとパフォーマンスの計測・管理を行うほか、運用リスク管理会議を開催してこれらの管理状況を検証しております。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

項目	前期 2020年4月15日現在	当期 2020年10月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	投資証券 「(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。 先物取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権 短期で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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)

前期(自2019年10月16日至2020年4月15日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	△54,682,361,997
合計	△54,682,361,997

当期(自2020年4月16日至2020年10月15日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	3,437,178,375
合計	3,437,178,375

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(投資証券関連)

前期 (2020年 4月 15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	東証REIT指数先物取引 買建	6,106,759,800	—	5,289,210,000	△817,549,800
合計		6,106,759,800	—	5,289,210,000	△817,549,800

当期 (2020年 10月 15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	東証REIT指数先物取引 買建	6,864,635,300	—	6,805,401,000	△59,234,300
合計		6,864,635,300	—	6,805,401,000	△59,234,300

(注) 時価の算定方法

1. 先物取引の時価評価については、原則として計算日に知り得る直近の日の主たる取引所の発表する清算値段、又は最終相場に基づいて評価しております。
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は含んでおりません。

※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。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

①株式

該当事項はありません。

②株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	3,210	356,631,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	4,807	459,068,500	
	S O S i L A 物流リート投資法人	4,376	582,883,200	
	日本アコモデーションファンド投資法人	6,527	3,785,660,000	
	MCUBS M i d C i t y 投資法人	24,035	2,014,133,000	
	森ヒルズリート投資法人	23,074	3,091,916,000	
	産業ファンド投資法人	27,766	4,817,401,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	18,658	5,491,049,400	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	12,815	2,197,772,500	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	9,843	4,089,766,500	
	G L P 投資法人	56,480	9,200,592,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	8,571	2,500,160,700	
	日本プロロジスリート投資法人	29,722	10,283,812,000	
	星野リゾート・リート投資法人	2,989	1,590,148,000	
	O n e リート投資法人	3,062	763,356,600	
	イオンリート投資法人	19,923	2,428,613,700	
	ヒューリックリート投資法人	15,814	2,237,681,000	
	日本リート投資法人	6,380	2,239,380,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	126,195	1,783,135,350	
	積水ハウス・リート投資法人	57,774	4,396,601,400	
	トーセイ・リート投資法人	4,346	488,490,400	
	ケネディクス商業リート投資法人	7,223	1,503,828,600	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	4,190	519,560,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	3,781	380,746,700	
	野村不動産マスターファンド投資法人	63,520	8,746,704,000	
	いちごホテルリート投資法人	3,435	254,877,000	
	ラサールロジポート投資法人	21,890	3,655,630,000	
	スターアジア不動産投資法人	20,182	922,317,400	
	マリモ地方創生リート投資法人	1,840	202,952,000	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	6,856	3,369,724,000	

大江戸温泉リート投資法人	3,170	224,119,000	
投資法人みらい	21,214	843,256,500	
森トラスト・ホテルリート投資法人	4,254	499,845,000	
三菱地所物流リート投資法人	4,420	1,805,570,000	
CREロジスティクスファンド投資法人	5,360	860,280,000	
ザイマックス・リート投資法人	3,010	268,492,000	
タカラレーベン不動産投資法人	5,903	515,331,900	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	6,202	885,645,600	
日本ビルファンド投資法人	19,022	10,652,320,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	19,643	10,312,575,000	
日本リテールファンド投資法人	36,904	6,244,156,800	
オリックス不動産投資法人	39,138	6,152,493,600	
日本プライムリアルティ投資法人	12,230	4,011,440,000	
プレミアム投資法人	17,742	2,200,008,000	
東急リアル・エステート投資法人	13,170	1,929,405,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	13,640	1,354,452,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	42,008	5,166,984,000	
森トラスト総合リート投資法人	14,039	1,857,359,700	
インヴィンシブル投資法人	82,133	2,891,081,600	
フロンティア不動産投資法人	6,519	2,398,992,000	
平和不動産リート投資法人	12,232	1,406,680,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	12,834	3,719,293,200	
福岡リート投資法人	10,159	1,359,274,200	
ケネディクス・オフィス投資法人	6,076	3,888,640,000	
いちごオフィスリート投資法人	16,296	1,251,532,800	
大和証券オフィス投資法人	4,185	2,544,480,000	
阪急阪神リート投資法人	8,872	1,070,850,400	
スターツプロシード投資法人	3,059	628,318,600	
大和ハウスリート投資法人	28,026	7,230,708,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	63,278	3,448,651,000	
大和証券リビング投資法人	24,781	2,552,443,000	
ジャパンエクセレント投資法人	18,227	2,214,580,500	
合計	1,177,030	176,743,851,350	

(注1) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

当表に記載すべき内容は、「(3) 注記表 (デリバティブ取引等に関する注記)」に開示しておりますので、記載を省略しております。