

平成26年10月期 決算短信（平成26年7月16日～平成26年10月15日）

平成26年11月21日

ファンド名 NZAM 上場投信 東証REIT指数
 コード番号 1595
 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 <http://www.ja-asset.co.jp/>
 代表者 代表取締役社長 高谷 正伸
 問合せ先責任者 企画部 業務企画グループ 次長 田原 輝行 (TEL) 03-5210-8779
 有価証券報告書提出予定日 平成26年12月22日
 分配金支払開始予定日 平成26年11月21日

I ファンドの運用状況

1. 平成26年10月期の運用状況（平成26年7月16日～平成26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	%
26年10月期	25,134	(99.5)	132	(0.5)	25,267	(100)
26年7月期	17,613	(99.9)	16	(0.1)	17,630	(100)

(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
26年10月期	11,001	4,513	—	15,515
26年7月期	—	11,001	—	11,001

(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
26年10月期	25,456	189	25,267	162,858
26年7月期	17,764	133	17,630	160,250

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
26年10月期	110
26年7月期	110

(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 財務諸表等

(1) 貸借対照表

	前期 平成 26 年 7 月 15 日現在	当期 平成 26 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	35,991,533	153,761,817
投資証券	17,613,403,400	25,134,982,600
未収配当金	114,747,828	162,004,034
未収利息	37	140
差入委託証拠金	-	6,052,000
流動資産合計	17,764,142,798	25,456,800,591
資産合計	17,764,142,798	25,456,800,591
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	115,348
前受金	-	508,200
未払金	-	962,093
未払収益分配金	121,018,700	170,667,200
未払受託者報酬	1,668,245	2,228,372
未払委託者報酬	9,219,211	12,314,674
その他未払費用	1,983,447	2,284,326
流動負債合計	133,889,603	189,080,213
負債合計	133,889,603	189,080,213
純資産の部		
元本等		
元本	16,337,524,500	23,040,072,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	1,292,728,695	2,227,648,378
(分配準備積立金)	939,688	734,577
元本等合計	17,630,253,195	25,267,720,378
純資産合計	17,630,253,195	25,267,720,378
負債純資産合計	17,764,142,798	25,456,800,591

(2) 損益及び剰余金計算書

	前期	当期
	自 平成 26 年 3 月 6 日 至 平成 26 年 7 月 15 日	自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 10 月 15 日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	134,826,766	187,277,467
受取利息	2,525	11,993
有価証券売買等損益	1,242,287,252	239,354,062
派生商品取引等損益	2,585,681	1,426,680
その他収益	-	1
営業収益合計	1,379,702,224	428,070,203
営業費用		
受託者報酬	1,668,245	2,228,372
委託者報酬	9,219,211	12,314,674
その他費用	1,983,447	2,284,326
営業費用合計	12,870,903	16,827,372
営業利益又は営業損失 (△)	1,366,831,321	411,242,831
経常利益又は経常損失 (△)	1,366,831,321	411,242,831
当期純利益又は当期純損失 (△)	1,366,831,321	411,242,831
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 (△)	-	1,292,728,695
剰余金増加額又は欠損金減少額	46,916,074	694,344,052
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	46,916,074	694,344,052
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
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	121,018,700	170,667,200
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	1,292,728,695	2,227,648,378

(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）、又は第一種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 受取配当金は、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	当期
		平成 26 年 7 月 15 日現在	平成 26 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	984,555,000 円	16,337,524,500 円
	期中追加設定元本額	15,352,969,500 円	6,702,547,500 円
	期中一部交換元本額	－円	－円
2.	特定期間の末日における受益権の総数	11,001,700 口	15,515,200 口
3.	1 口当たり純資産額	1,602.50 円	1,628.58 円
	(100 口当たり純資産額)	(160,250 円)	(162,858 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 平成 26 年 3 月 6 日 至 平成 26 年 7 月 15 日	自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 10 月 15 日
分配金の計算過程	第 1 期	第 2 期
	自 平成 26 年 3 月 6 日	自 平成 26 年 7 月 16 日
	至 平成 26 年 7 月 15 日	至 平成 26 年 10 月 15 日
	A. 配当等収益額 134,829,291 円	A. 配当等収益額 187,289,461 円
	B. 分配準備積立金額 0 円	B. 分配準備積立金額 939,688 円
	C. 配当等収益合計額 134,829,291 円	C. 配当等収益合計額 188,229,149 円
	(A+B)	(A+B)
	D. 経費 12,870,903 円	D. 経費 16,827,372 円
	E. 収益分配可能額 121,958,388 円	E. 収益分配可能額 171,401,777 円
	(C-D)	(C-D)
	F. 収益分配金 121,018,700 円	F. 収益分配金 170,667,200 円
G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F) 939,688 円	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F) 734,577 円	
H. 口数 11,001,700 口	H. 口数 15,515,200 口	
I. 100 口当たり分配金 1,100 円	I. 100 口当たり分配金 1,100 円	
(F/H×100)	(F/H×100)	

(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 平成 26 年 3 月 6 日 至 平成 26 年 7 月 15 日	当期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 26 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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>当該金融商品は、価格変動リスク、流動性リスク、有価証券の貸し付けにおけるリスク等に晒されています。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	<p>フロント部門では、トラッキング・エラー（市場全体の動きとファンドが乖離するリスク）の水準を管理しています。また、資産ポートフォリオ委員会で決められた方針の範囲内となるよう、管理を行っております。</p> <p>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。</p>	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

項目	前期	当期
	平成 26 年 7 月 15 日現在	平成 26 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。 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。	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。
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(自平成 26 年 3 月 6 日 至平成 26 年 7 月 15 日)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	1, 231, 226, 630
合計	1, 231, 226, 630

当期(自平成 26 年 7 月 16 日 至平成 26 年 10 月 15 日)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	231, 563, 524
合計	231, 563, 524

(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 (平成 26 年 7 月 15 日現在)

該当事項はありません。

当期 (平成 26 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	108,251,900	-	108,138,000	△113,900
合計		108,251,900	-	108,138,000	△113,900

(注) 時価の算定方法

1. 東証 REIT 指数先物取引の時価評価については、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。
 2. 東証 REIT 指数先物取引の残高は、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	日本アコモデーションファンド投資法人	1,314	500,634,000	
	M I Dリート投資法人	524	141,794,400	
	森ヒルズリート投資法人	4,470	665,583,000	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	462	262,878,000	
	産業ファンド投資法人	474	420,912,000	
	大和ハウスリート投資法人	833	393,176,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	3,708	922,921,200	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	794	220,811,400	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	719	619,778,000	
	G L P投資法人	6,817	822,811,900	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,149	238,187,700	
	日本プロロジスリート投資法人	4,912	1,201,966,400	
	野村不動産マスターファンド投資法人	4,749	620,694,300	
	星野リゾート・リート投資法人	123	138,252,000	
	S I A不動産投資法人	216	92,880,000	
	イオンリート投資法人	2,708	362,330,400	
	ヒューリックリート投資法人	1,856	305,868,800	
	日本リート投資法人	430	131,150,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	1,237	126,545,100	
	日本ビルファンド投資法人	4,024	2,229,296,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	3,563	1,970,339,000	
	日本リテールファンド投資法人	6,916	1,486,940,000	
	オリックス不動産投資法人	6,020	824,740,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	2,350	881,250,000	
	プレミアム投資法人	624	297,024,000	
	東急リアル・エステート投資法人	2,782	400,886,200	
	グローバル・ワン不動産投資法人	551	184,034,000	
	野村不動産オフィスファンド投資法人	1,061	515,646,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	7,159	1,183,382,700	
	森トラスト総合リート投資法人	3,762	728,323,200	

インヴィンシブル投資法人	7,608	272,746,800	
フロンティア不動産投資法人	1,414	704,172,000	
平和不動産リート投資法人	2,510	217,617,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,364	561,213,600	
福岡リート投資法人	1,965	380,227,500	
ケネディクス・オフィス投資法人	1,014	575,952,000	
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	2,607	265,131,900	
いちご不動産投資法人	2,929	239,006,400	
大和証券オフィス投資法人	1,259	706,299,000	
阪急リート投資法人	343	209,230,000	
スターツプロシード投資法人	411	74,596,500	
トップリート投資法人	503	231,380,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	1,064	491,568,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	7,953	520,126,200	
日本賃貸住宅投資法人	4,201	319,276,000	
ジャパンエクセレント投資法人	3,460	475,404,000	
合計	117,912	25,134,982,600	

(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。