

2021年10月期 決算短信 (2021年4月16日～2021年10月15日)

2021年11月17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	牛窪	克彦
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	2022年1月14日		
分配金支払開始予定日	2021年11月22日		

I ファンドの運用状況

1. 2021年10月期の運用状況 (2021年4月16日～2021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	%
2021年10月期	193,531	(97.8)	4,415	(2.2)	197,946	(100.0)
2021年4月期	196,575	(98.2)	3,644	(1.8)	200,219	(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
2021年10月期	97,178	18,302	22,227	93,253
2021年4月期	106,217	12,908	21,947	97,178

(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
2021年10月期	200,015	2,068	197,946	212,267
2021年4月期	203,059	2,839	200,219	206,034

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
2021年10月期	193
2021年4月期	230

(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

NZAM 上場投信 東証 REIT 指数

(1) 【貸借対照表】

	前期 2021年4月15日現在	当期 2021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	3,608,990,016	3,299,306,194
投資証券	196,575,606,000	193,531,376,500
派生商品評価勘定	233,411,956	8,590,600
未収入金	233,622,862	914,285,600
未収配当金	2,099,709,483	1,816,463,596
前払金	-	171,352,780
差入委託証拠金	308,016,000	273,790,000
流動資産合計	203,059,356,317	200,015,165,270
資産合計	203,059,356,317	200,015,165,270
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	68,455,464
前受金	450,214,500	-
未払金	-	52,386,040
未払収益分配金	2,235,099,382	1,799,789,153
未払受託者報酬	21,037,497	20,158,500
未払委託者報酬	116,259,813	111,402,235
未払利息	1,938	7,518
その他未払費用	16,998,271	16,476,145
流動負債合計	2,839,611,401	2,068,675,055
負債合計	2,839,611,401	2,068,675,055
純資産の部		
元本等		
元本	144,309,677,490	138,481,186,140
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	55,910,067,426	59,465,304,075
(分配準備積立金)	564,707	4,328,676
元本等合計	200,219,744,916	197,946,490,215
純資産合計	200,219,744,916	197,946,490,215
負債純資産合計	203,059,356,317	200,015,165,270

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	前期	当期
	自 2020年10月16日 至 2021年4月15日	自 2021年4月16日 至 2021年10月15日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	3,888,396,614	3,236,458,758
受取利息	53,574	37,005
有価証券売買等損益	34,553,872,623	5,580,085,371
派生商品取引等損益	811,157,964	130,450,814
その他収益	73,038,305	775,486
営業収益合計	39,326,519,080	8,947,807,434
営業費用		
支払利息	599,343	569,243
受託者報酬	41,023,003	40,342,213
委託者報酬	226,705,990	222,943,761
その他費用	35,125,573	32,900,541
営業費用合計	303,453,909	296,755,758
営業利益又は営業損失 (△)	39,023,065,171	8,651,051,676
経常利益又は経常損失 (△)	39,023,065,171	8,651,051,676
当期純利益又は当期純損失 (△)	39,023,065,171	8,651,051,676
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 (△)	25,971,450,636	55,910,067,426
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,639,187,073	12,472,067,845
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	4,639,187,073	12,472,067,845
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,063,015,785	14,631,131,350
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	10,063,015,785	14,631,131,350
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	3,660,619,669	2,936,751,522
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	55,910,067,426	59,465,304,075

(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	<p>投資証券</p> <p>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。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>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。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

前期 (2021年4月15日現在)	当期 (2021年10月15日現在)
当特定期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当特定期間の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。	同左

(貸借対照表に関する注記)

項目		前期 2021年4月15日現在	当期 2021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	157,733,318,655円	144,309,677,490円
	期中追加設定元本額	19,168,974,000円	27,179,064,000円
	期中一部交換元本額	32,592,615,165円	33,007,555,350円
2.	特定期間の末日における受益権の総数	97,178,234口	93,253,324口
3.	1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	2,060.34円 (206,034円)	2,122.67円 (212,267円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期		当期	
	自 2020年10月16日 至 2021年4月15日		自 2021年4月16日 至 2021年10月15日	
分配金の計算過程	第27期		第29期	
	自 2020年10月16日 至 2021年1月15日		自 2021年4月16日 至 2021年7月15日	
	A. 配当等収益額	1,579,592,032 円	A. 配当等収益額	1,287,075,436 円
	B. 分配準備積立金額	3,149,792 円	B. 分配準備積立金額	564,707 円
	C. 配当等収益合計額 (A+B)	1,582,741,824 円	C. 配当等収益合計額 (A+B)	1,287,640,143 円
	D. 経費	148,558,929 円	D. 経費	148,149,533 円
	E. 収益分配可能額 (C-D)	1,434,182,895 円	E. 収益分配可能額 (C-D)	1,139,490,610 円
	F. 収益分配金	1,425,520,287 円	F. 収益分配金	1,136,962,369 円
	G. 次期繰越金(分配準備積立金)(E-F)	8,662,608 円	G. 次期繰越金(分配準備積立金)(E-F)	2,528,241 円
	H. 口数	114,041,623 口	H. 口数	92,435,965 口
	I. 100口当たり分配金 (F/H×100)	1,250 円	I. 100口当たり分配金 (F/H×100)	1,230 円
	第28期		第30期	
	自 2021年1月16日 至 2021年4月15日		自 2021年7月16日 至 2021年10月15日	
	A. 配当等収益額	2,381,297,118 円	A. 配当等収益額	1,949,626,570 円
	B. 分配準備積立金額	8,662,608 円	B. 分配準備積立金額	2,528,241 円
	C. 配当等収益合計額 (A+B)	2,389,959,726 円	C. 配当等収益合計額 (A+B)	1,952,154,811 円
	D. 経費	154,295,637 円	D. 経費	148,036,982 円
	E. 収益分配可能額 (C-D)	2,235,664,089 円	E. 収益分配可能額 (C-D)	1,804,117,829 円
	F. 収益分配金	2,235,099,382 円	F. 収益分配金	1,799,789,153 円
	G. 次期繰越金(分配準備積立金)(E-F)	564,707 円	G. 次期繰越金(分配準備積立金)(E-F)	4,328,676 円
	H. 口数	97,178,234 口	H. 口数	93,253,324 口
	I. 100口当たり分配金 (F/H×100)	2,300 円	I. 100口当たり分配金 (F/H×100)	1,930 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 2020年10月16日 至 2021年4月15日	当期 自 2021年4月16日 至 2021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 2021年4月15日現在	当期 2021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つた場合、当該価額が異なることもあります。	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つた場合、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)

前期(自2020年10月16日至2021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	26,219,586,056
合計	26,219,586,056

当期(自2021年4月16日至2021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	△6,027,150,392
合計	△6,027,150,392

(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 (2021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	3,317,853,500	—	3,551,304,000	233,450,500
合計		3,317,853,500	—	3,551,304,000	233,450,500

当期 (2021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	4,278,723,380	—	4,218,903,000	△59,820,380
合計		4,278,723,380	—	4,218,903,000	△59,820,380

(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	3,407	478,683,500	
	サンケイリアルエステート投資法人	5,345	654,762,500	
	S O S i L A 物流リート投資法人	7,097	1,188,037,800	
	東海道リート投資法人	1,296	138,542,400	
	日本アコモデーションファンド投資法人	5,842	3,756,406,000	
	森ヒルズリート投資法人	19,896	3,063,984,000	
	産業ファンド投資法人	24,020	5,015,376,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	16,917	6,242,373,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	11,556	2,553,876,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	9,017	4,183,888,000	
	G L P 投資法人	54,798	10,296,544,200	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	7,618	2,559,648,000	
	日本プロロジスリート投資法人	26,805	10,038,472,500	
	星野リゾート・リート投資法人	2,611	1,908,641,000	
	O n e リート投資法人	2,936	874,634,400	
	イオンリート投資法人	19,898	3,064,292,000	
	ヒューリックリート投資法人	14,874	2,650,546,800	
	日本リート投資法人	5,221	2,258,082,500	
	積水ハウス・リート投資法人	49,765	4,628,145,000	
	トーセイ・リート投資法人	3,535	491,011,500	
	ケネディクス商業リート投資法人	6,755	1,951,519,500	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	3,609	559,395,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	3,833	454,977,100	
	野村不動産マスターファンド投資法人	54,714	9,257,608,800	
	いちごホテルリート投資法人	2,803	258,997,200	
	ラサールロジポート投資法人	20,713	4,020,393,300	
	スターアジア不動産投資法人	17,485	1,017,627,000	
	マリモ地方創生リート投資法人	1,586	206,338,600	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	6,289	3,754,533,000	
	大江戸温泉リート投資法人	2,731	223,942,000	

投資法人みらい	19,288	1,053,124,800	
森トラスト・ホテルリート投資法人	3,969	551,294,100	
三菱地所物流リート投資法人	4,300	2,100,550,000	
CRE ロジスティクスファンド投資法人	6,553	1,393,167,800	
ザイマックス・リート投資法人	2,455	286,989,500	
タカラレーベン不動産投資法人	6,663	736,261,500	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	6,597	1,050,902,100	
日本ビルファンド投資法人	19,175	13,806,000,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	16,920	11,776,320,000	
日本都市ファンド投資法人	85,368	9,390,480,000	
オリックス不動産投資法人	33,712	6,445,734,400	
日本プライムリアルティ投資法人	11,119	4,592,147,000	
NTT都市開発リート投資法人	15,282	2,356,484,400	
東急リアル・エステート投資法人	11,344	2,141,747,200	
グローバル・ワン不動産投資法人	11,749	1,378,157,700	
ユナイテッド・アーバン投資法人	38,089	5,412,446,900	
森トラスト総合リート投資法人	12,093	1,788,554,700	
インヴィンシブル投資法人	74,470	3,228,274,500	
フロンティア不動産投資法人	5,931	2,995,155,000	
平和不動産リート投資法人	10,961	1,754,856,100	
日本ロジスティクスファンド投資法人	11,055	3,758,700,000	
福岡リート投資法人	8,751	1,491,170,400	
ケネディクス・オフィス投資法人	5,234	3,852,224,000	
いちごオフィスリート投資法人	13,863	1,265,691,900	
大和証券オフィス投資法人	3,577	2,632,672,000	
阪急阪神リート投資法人	7,643	1,283,259,700	
スターツプロシード投資法人	2,635	656,378,500	
大和ハウスリート投資法人	25,405	8,370,947,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	51,834	3,446,961,000	
大和証券リビング投資法人	22,862	2,619,985,200	
ジャパンエクセレント投資法人	15,700	2,163,460,000	
合計	977,569	193,531,376,500	

(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。