

平成30年10月期 決算短信（平成30年4月16日～平成30年10月15日）

平成30年11月26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 吉田 一生
 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31年1月15日
 分配金支払開始予定日 平成30年11月22日

I ファンドの運用状況

1. 平成30年10月期の運用状況（平成30年4月16日～平成30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	%
30年10月期	160,062	(98.8)	1,879	(1.2)	161,941	(100.0)
30年4月期	145,774	(98.3)	2,526	(1.7)	148,300	(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
30年10月期	86,758	7,494	2,220	92,033
30年4月期	53,663	38,258	5,162	86,758

(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
30年10月期	163,644	1,703	161,941	175,959
30年4月期	149,631	1,331	148,300	170,934

(4) 分配金

	10口当たり分配金
	円
30年10月期	170
30年4月期	135

(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 平成 30 年 4 月 15 日現在	当期 平成 30 年 10 月 15 日現在
	金額 (円)	金額 (円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	179,834,618
コール・ローン	2,531,695,653	1,722,432,408
投資証券	145,774,540,810	160,062,087,710
派生商品評価勘定	11,833,920	1,803,714
未収入金	29,563,076	2,248,068
未収配当金	1,222,636,220	1,619,116,802
差入委託証拠金	61,393,000	57,060,000
流動資産合計	149,631,662,679	163,644,583,320
資産合計	149,631,662,679	163,644,583,320
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	14,215,336	5,241,372
前受金	55,349,300	12,837,700
未払収益分配金	1,171,245,879	1,564,567,273
未払受託者報酬	12,182,284	16,527,511
未払委託者報酬	67,323,112	91,336,184
未払利息	14,848	3,447
その他未払費用	10,713,469	12,863,974
流動負債合計	1,331,044,228	1,703,377,461
負債合計	1,331,044,228	1,703,377,461
純資産の部		
元本等		
元本	128,837,046,690	136,669,552,965
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	19,463,571,761	25,271,652,894
(分配準備積立金)	3,804,013	8,535,019
元本等合計	148,300,618,451	161,941,205,859
純資産合計	148,300,618,451	161,941,205,859
負債純資産合計	149,631,662,679	163,644,583,320

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	前期	当期
	自 平成 29 年 10 月 16 日 至 平成 30 年 4 月 15 日	自 平成 30 年 4 月 16 日 至 平成 30 年 10 月 15 日
	金額 (円)	金額 (円)
営業収益		
受取配当金	2,220,418,829	3,021,149,400
受取利息	5,235	-
有価証券売買等損益	4,370,393,271	4,252,100,672
派生商品取引等損益	51,689,268	65,517,896
その他収益	99	3,501
営業収益合計	6,642,506,702	7,338,771,469
営業費用		
支払利息	305,773	397,296
受託者報酬	21,915,016	32,473,591
委託者報酬	121,109,254	179,459,223
その他費用	19,992,326	25,916,479
営業費用合計	163,322,369	238,246,589
営業利益又は営業損失 (△)	6,479,184,333	7,100,524,880
経常利益又は経常損失 (△)	6,479,184,333	7,100,524,880
当期純利益又は当期純損失 (△)	6,479,184,333	7,100,524,880
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 (△)	8,067,236,232	19,463,571,761
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,159,756,980	2,122,986,874
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	8,159,756,980	2,122,986,874
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,185,068,120	637,255,315
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,185,068,120	637,255,315
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	2,057,537,664	2,778,175,306
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	19,463,571,761	25,271,652,894

(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 平成 30 年 4 月 15 日現在	当期 平成 30 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	79,690,193,550 円	128,837,046,690 円
	期中追加設定元本額	56,813,872,500 円	11,129,926,500 円
	期中一部交換元本額	7,667,019,360 円	3,297,420,225 円
2.	特定期間の末日における受益権の総数	86,758,954 口	92,033,369 口
3.	1 口当たり純資産額 (100 口当たり純資産額)	1,709.34 円 (170,934 円)	1,759.59 円 (175,959 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 29 年 10 月 16 日 至 平成 30 年 4 月 15 日		自 平成 30 年 4 月 16 日 至 平成 30 年 10 月 15 日	
分配金の計算過程	第 15 期		第 17 期	
	自 平成 29 年 10 月 16 日 至 平成 30 年 1 月 15 日		自 平成 30 年 4 月 16 日 至 平成 30 年 7 月 15 日	
	A. 配当等収益額	954,848,353 円	A. 配当等収益額	1,327,369,471 円
	B. 分配準備積立金額	4,239,883 円	B. 分配準備積立金額	3,804,013 円
	C. 配当等収益合計額 (A+B)	959,088,236 円	C. 配当等収益合計額 (A+B)	1,331,173,484 円
	D. 経費	72,782,257 円	D. 経費	116,785,431 円
	E. 収益分配可能額 (C-D)	886,305,979 円	E. 収益分配可能額 (C-D)	1,214,388,053 円
	F. 収益分配金	886,291,785 円	F. 収益分配金	1,213,608,033 円
	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F)	14,194 円	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F)	780,020 円
	H. 口数	59,086,119 口	H. 口数	88,584,528 口
	I. 100 口当たり分配金 (F/H×100)	1,500 円	I. 100 口当たり分配金 (F/H×100)	1,370 円
	第 16 期		第 18 期	
	自 平成 30 年 1 月 16 日 至 平成 30 年 4 月 15 日		自 平成 30 年 7 月 16 日 至 平成 30 年 10 月 15 日	
	A. 配当等収益額	1,265,270,037 円	A. 配当等収益額	1,693,386,134 円
	B. 分配準備積立金額	14,194 円	B. 分配準備積立金額	780,020 円
	C. 配当等収益合計額 (A+B)	1,265,284,231 円	C. 配当等収益合計額 (A+B)	1,694,166,154 円
	D. 経費	90,234,339 円	D. 経費	121,063,862 円
	E. 収益分配可能額 (C-D)	1,175,049,892 円	E. 収益分配可能額 (C-D)	1,573,102,292 円
	F. 収益分配金	1,171,245,879 円	F. 収益分配金	1,564,567,273 円
	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F)	3,804,013 円	G. 次期繰越金(分配準備積立金) (E-F)	8,535,019 円
	H. 口数	86,758,954 口	H. 口数	92,033,369 口
	I. 100 口当たり分配金 (F/H×100)	1,350 円	I. 100 口当たり分配金 (F/H×100)	1,700 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 平成 29 年 10 月 16 日 至 平成 30 年 4 月 15 日	当期 自 平成 30 年 4 月 16 日 至 平成 30 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、価格変動リスク、流動性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、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。 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 平成 30 年 4 月 15 日現在	当期 平成 30 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(自平成 29 年 10 月 16 日 至平成 30 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	△619,578,463
合計	△619,578,463

当期(自平成 30 年 4 月 16 日 至平成 30 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	△2,435,923,141
合計	△2,435,923,141

(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 30 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	2,397,709,700	—	2,395,359,000	△2,350,700
合計		2,397,709,700	—	2,395,359,000	△2,350,700

当期 (平成 30 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	1,732,451,100	—	1,729,035,000	△3,416,100
合計		1,732,451,100	—	1,729,035,000	△3,416,100

(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	6,287	3,162,361,000	
	MCUBS MidCity 投資法人	21,339	1,809,547,200	
	森ヒルズリート投資法人	21,722	3,030,219,000	
	産業ファンド投資法人	22,078	2,512,476,400	
	アドバンス・レジデンス投資法人	18,469	5,265,511,900	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	11,244	1,926,097,200	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	9,076	4,342,866,000	
	GLP 投資法人	46,942	5,187,091,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	7,225	1,936,300,000	
	日本プロロジスリート投資法人	25,407	5,683,545,900	
	星野リゾート・リート投資法人	2,886	1,575,756,000	
	One リート投資法人	2,760	665,436,000	
	イオンリート投資法人	19,441	2,362,081,500	
	ヒューリックリート投資法人	13,668	2,173,212,000	
	日本リート投資法人	6,113	2,200,680,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	112,307	1,789,050,510	
	日本ヘルスケア投資法人	859	151,269,900	
	積水ハウス・リート投資法人	48,875	3,523,887,500	
	トーセイ・リート投資法人	3,044	347,320,400	
	ケネディクス商業リート投資法人	6,952	1,669,175,200	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	2,506	282,927,400	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	3,786	339,604,200	
	野村不動産マスターファンド投資法人	56,145	8,365,605,000	
	いちごホテルリート投資法人	3,322	455,114,000	
	ラサールロジポート投資法人	14,296	1,456,762,400	
	スターアジア不動産投資法人	5,875	605,125,000	
	マリモ地方創生リート投資法人	1,635	181,648,500	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,228	1,066,854,000	

大江戸温泉リート投資法人	3,056	261,593,600	
さくら総合リート投資法人	4,102	365,488,200	
投資法人みらい	4,401	833,109,300	
森トラスト・ホテルリート投資法人	4,438	603,568,000	
三菱地所物流リート投資法人	1,999	493,353,200	
CRE ロジスティクスファンド投資法人	1,894	205,309,600	
ザイマックス・リート投資法人	1,749	196,762,500	
タカラレーベン不動産投資法人	2,839	248,980,300	
日本ビルファンド投資法人	18,355	11,838,975,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	18,935	10,849,755,000	
日本リテールファンド投資法人	35,815	7,299,097,000	
オリックス不動産投資法人	37,753	6,569,022,000	
日本プライムリアルティ投資法人	11,994	4,773,612,000	
プレミアム投資法人	18,013	2,078,700,200	
東急リアル・エステート投資法人	12,700	1,978,660,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	12,111	1,375,809,600	
ユナイテッド・アーバン投資法人	41,774	7,243,611,600	
森トラスト総合リート投資法人	13,549	2,174,614,500	
インヴィンシブル投資法人	66,282	3,078,798,900	
フロンティア不動産投資法人	6,450	2,776,725,000	
平和不動産リート投資法人	11,805	1,299,730,500	
日本ロジスティクスファンド投資法人	12,504	2,785,891,200	
福岡リート投資法人	9,792	1,670,515,200	
ケネディクス・オフィス投資法人	5,865	4,158,285,000	
いちごオフィスリート投資法人	15,715	1,455,209,000	
大和証券オフィス投資法人	4,367	2,938,991,000	
阪急阪神リート投資法人	7,858	1,101,691,600	
スターツプロシード投資法人	2,986	509,113,000	
大和ハウスリート投資法人	23,711	6,020,222,900	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	54,852	4,399,130,400	
日本賃貸住宅投資法人	21,301	1,891,528,800	
ジャパンエクセレント投資法人	16,961	2,518,708,500	
合計	1,003,413	160,062,087,710	

(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。