平成26年7月期　決算短信（平成26年3月6日～平成26年7月15日）

平成26年8月22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	http://www.ja-asset.co.jp/		
代表者	代表取締役社長	髙谷　正伸	
問合せ先責任者	企画部　業務企画グループ　次長	山内　馨	（TEL）03－5210－8550
有価証券報告書提出予定日	平成26年10月15日		
分配金支払開始予定日	平成26年　8月22日		

Ⅰ　ファンドの運用状況

1．平成26年7月期の運用状況（平成26年3月6日～平成26年7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/当計算期間末発行済口数）×100）
	百万円	百万円	百万円	円
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

	第1期 平成26年 7月15日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	35,991,533
投資証券	17,613,403,400
未収配当金	114,747,828
未収利息	37
流動資産合計	17,764,142,798
資産合計	17,764,142,798
負債の部	
流動負債	
未払収益分配金	121,018,700
未払受託者報酬	1,668,245
未払委託者報酬	9,219,211
その他未払費用	1,983,447
流動負債合計	133,889,603
負債合計	133,889,603
純資産の部	
元本等	
元本	16,337,524,500
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,292,728,695
（分配準備積立金）	939,688
元本等合計	17,630,253,195
純資産合計	17,630,253,195
負債純資産合計	17,764,142,798

（２）損益及び剰余金計算書

	第１期 自　平成 26 年 3 月 6 日 至　平成 26 年 7 月 15 日
	金額（円）
営業収益	
受取配当金	134,826,766
受取利息	2,525
有価証券売買等損益	1,242,287,252
派生商品取引等損益	2,585,681
営業収益合計	1,379,702,224
営業費用	
受託者報酬	1,668,245
委託者報酬	9,219,211
その他費用	1,983,447
営業費用合計	12,870,903
営業利益又は営業損失（△）	1,366,831,321
経常利益又は経常損失（△）	1,366,831,321
当期純利益又は当期純損失（△）	1,366,831,321
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（△）	－
剰余金増加額又は欠損金減少額	46,916,074
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
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
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,292,728,695

（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、原則として計算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		第１期 平成 26 年 7 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
	期中追加設定元本額	15,352,969,500 円
	期中一部交換元本額	－円
２.	計算期間の末日における受益権の総数	11,001,700 口
３.	１口当たり純資産額 (100 口当たり純資産額)	1,602.50 円 (160,250 円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第１期 自 平成 26 年 3 月 6 日 至 平成 26 年 7 月 15 日	
分配金の計算過程	第１期	
	自　平成 26 年 3 月 6 日	
	至　平成 26 年 7 月 15 日	
	Ａ．配当等収益額	134,829,291 円
	Ｂ．分配準備積立金	0 円
	Ｃ．配当等収益合計額（Ａ+Ｂ）	134,829,291 円
	Ｄ．経費	12,870,903 円
	Ｅ．収益分配可能額（Ｃ-Ｄ）	121,958,388 円
	Ｆ．収益分配金	121,018,700 円
	Ｇ．次期繰越金(分配準備積立金)（Ｅ-Ｆ）	939,688 円
	Ｈ．口数	11,001,700 口
	Ｉ．100 口当たり分配金（Ｆ/Ｈ×100）	1,100 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	第1期 自 平成26年 3月 6日 至 平成26年 7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。
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、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。
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。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 平成26年 7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。
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。
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。

（有価証券に関する注記）

当期(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

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（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	963	372,681,000	
	ＭＩＤリート投資法人	383	91,805,100	
	森ヒルズリート投資法人	2,889	433,350,000	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	335	188,605,000	
	産業ファンド投資法人	345	313,950,000	
	大和ハウスリート投資法人	612	277,236,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,712	671,491,200	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	504	121,665,600	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	524	487,320,000	
	ＧＬＰ投資法人	4,376	493,612,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	210	158,970,000	
	日本プロロジスリート投資法人	3,262	766,570,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	3,474	425,217,600	
	星野リゾート・リート投資法人	90	79,020,000	
	ＳＩＡ不動産投資法人	157	67,274,500	
	イオンリート投資法人	1,982	268,164,600	
	ヒューリックリート投資法人	1,360	225,080,000	
	日本リート投資法人	317	82,483,400	
	日本ビルファンド投資法人	2,946	1,717,518,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,611	1,514,380,000	
	日本リテールファンド投資法人	4,815	1,077,597,000	
	オリックス不動産投資法人	4,102	574,690,200	
	日本プライムリアルティ投資法人	1,721	619,560,000	
	プレミア投資法人	456	189,012,000	
	東急リアル・エステート投資法人	2,039	290,353,600	

	グローバル・ワン不動産投資法人	404	123,018,000	
	野村不動産オフィスファンド投資法人	777	372,960,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	5,216	850,208,000	
	森トラスト総合リート投資法人	2,754	472,861,800	
	インヴィンシブル投資法人	3,282	83,691,000	
	フロンティア不動産投資法人	1,035	576,495,000	
	平和不動産リート投資法人	1,839	155,763,300	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,731	408,169,800	
	福岡リート投資法人	1,439	256,285,900	
	ケネディクス・オフィス投資法人	741	412,737,000	
	積水ハウス・ＳＩレジデンシャル投資法人	1,909	197,581,500	
	いちご不動産投資法人	2,141	149,441,800	
	大和証券オフィス投資法人	911	440,924,000	
	阪急リート投資法人	249	141,432,000	
	スターツプロシード投資法人	302	53,182,200	
	トップリート投資法人	367	166,067,500	
	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	780	368,160,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	5,468	305,661,200	
	日本賃貸住宅投資法人	3,077	222,774,800	
	ジャパンエクセレント投資法人	2,530	348,381,000	
合計		80,137	17,613,403,400	

(注1)券面総額欄の数値は、口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

該当事項はありません。