

投資信託資産構成内容
(バーゼルⅢ：標準的手法対応)

ファンド名
設定日
基準日
総口数
基準価額
純資産額

NZAM 上場投信 東証REIT指数	
設定日	2014年03月06日
基準日	2019年10月31日
総口数	98,921,987
基準価額	227,774 (円)
純資産額	225,318,866,337 (円)

リスクスルー適用区分
元本通貨
為替レート

計算対象外	JPY
	1.00

◆オンバランス項目に関する構成内容 (第1表)

(単位：一通貨単位)

項目	資産項目	リスクウェイト (%)	リスクウェイトの加重平均 (%)	信用リスク削減効果前			信用リスク削減効果後		
				資産の額 (時価金額)	信用リスクアセットの額	リスクアセット比率 (%/対純資産額)	資産の額 (時価金額)	信用リスクアセットの額	リスクアセット比率 (%/対純資産額)
1	現金	0							
2-1	我が国の中央政府及び中央銀行向け	0							
3-1		0							
3-2		20							
3-3	外国の中央政府及び中央銀行向け	50							
3-4		100							
3-5		150							
4	国際決済銀行等向け	0							
5	我が国の地方公共団体向け	0							
6-1		20							
6-2	外国の中央政府等以外の公共部門向け	50							
6-3		100							
6-4		150							
7-1		0							
7-2		20							
7-3	国際開発銀行向け	50							
7-4		100							
7-5		150							
8-1		10							
8-2	我が国の政府関係機関向け	20							
9-1		10							
9-2	地方公共団体金融機構向け	20							
10	地方三公社向け	20							
11-1		20		5,448,977,021	1,089,795,404	0.48%	5,448,977,021	1,089,795,404	0.48%
11-2		50							
11-3	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	100	20.00%						
11-4		150							
11-5		200							
11-6		250							
12-1		20							
12-2		50							
12-3	法人等向け	100							
12-4		150							
12-5		200							
12-6		250							
13	中小企業等向け及び個人向け	75							
14	抵当権付住宅ローン	35							
15-1	不動産取得等事業向け	100							
15-2		150							
16-1		50							
16-2	三月以上延滞等	100							
16-3		150							
17	取立未済手形	20							
18	信用保証協会等による保証付株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	10							
19		10							
20-1		100		221,539,573,266	221,539,573,266	98.32%	221,539,573,266	221,539,573,266	98.32%
20-2	出資等	200	100.00%						
20-3		250							
21	上記以外	100							
22-1		0~50未満							
22-2		50~100未満							
22-3	証券化商品(オリジネーター以外)	100~350未満							
22-4		350~1250未満							
22-5		1250							
23-1		0~100未満							
23-2		100~225未満							
23-3	再証券化商品(オリジネーター以外)	225~650未満							
23-4		650~1250未満							
23-5		1250							
24-1		0~150未満							
24-2	複数の資産を裏付とする資産(所謂ファンド)のうち、個々の資産の把握が困難な資産	150~350未満							
24-3		350~650未満							
24-4		650~1250未満							
24-5		1250							
52-1		0							
52-2	中央清算機関	2							
52-3		4							
52-4		20							
資産の総計				226,988,550,287			226,988,550,287		
リスクアセット計					222,629,368,670	98.81%		222,629,368,670	98.81%

金融機関出資計(時価金額)	対象普通株式等 適格旧非累積的永久優先株 適格旧資本調達手段 その他	TLAC関連調達手段
---------------	---	------------

注1) 採用する適格格付機関及び格付と告示上のリスク・ウェイトに関しては「バーゼルⅡにおける適格格付機関の格付と告示上のリスク・ウェイトとの対応関係(マッピング)について(平成十八年 金融庁)」に基づいています。
注2) 有価証券等及びその対価の受渡し又は決済を行う取引に係る未収金について計上していません。

※今後公表されるQ&A等によって、追加項目及び削除項目等が発生する可能性があります。

当資料は、バーゼル銀行監督委員会による自己資本比率規制に基づく自己資本比率の算出が必要となる受益者からの依頼に基づき作成したものであり、自己の責任において本件目的のために限って用いるものとし、これを他の目的のために利用し、又は第三者(監督官庁及び監査法人等を除く)へ開示、漏洩、伝達してはなりません。数値につきましては、上記の資産分類とリスクウェイトにより計算したものであり、告示等を参考にしてはいますが、必ずしも告示に基づくものではありません。当資料のデータ算出に際しては細心の注意を払って作成しておりますが、その正確性、完全性を保証するものではなく、その使用により生じた結果については、当社は責任を負うものではありません。

◆オフバランス項目に関する構成内容(第2表)

ルックスルー適用区分: 計算対象外

元本通貨: JPY

為替レート: 1

(単位: 一通貨単位)

項目	資産項目	掛け目 (%)	信用リスク削減効果前			信用リスク削減効果後		
			想定元本額	信用リスクアセット	リスクアセット比率 (%/対純資産額)	想定元本額	信用リスクアセット	リスクアセット比率 (%/対純資産額)
1	任意の時期に無条件で取消可能又は自動的に取消可能なコミットメント	0						
2	原契約期間が1年以下のコミットメント	20						
3	短期の貿易関連債券債務	20						
4	特定の取引に係る債券債務	50						
4-2	(うち経過措置を適用する元本補てん信託契約)	50						
5	NIF又はRUF	50						
6	原契約期間が1年超のコミットメント	50						
7	信用供与に直接代替する債券債務	100						
7-2	(うち借入金の保証)	100						
7-3	(うち有価証券の保証)	100						
7-4	(うち手形引受)	100						
7-5	(うち経過措置を適用する元本補てん信託契約)	100						
7-6	(うちクレジット・デリバティブのワザン提供)	100						
8	有価証券の貸付、現金若しくは有価証券による担保の提供又は有価証券の買戻条件付売却若しくは売戻条件付購入	100						
9	買戻条件付資産売却又は求償権付資産売却等	100						
10	先物購入、先渡預金、部分払込株式又は部分払込債券	100	5,271,783,000	5,271,783,000	2.34%	5,271,783,000	5,271,783,000	2.34%
11	派生商品取引	-	5,271,783,000	8,161,226	0.00%	5,271,783,000	8,161,226	0.00%
11-1	外国為替関連取引	-						
11-2	金利関連取引	-						
11-3	金関連取引	-						
11-4	株式関連取引	-	5,271,783,000	8,161,226	0.00%	5,271,783,000	8,161,226	0.00%
11-5	貴金属(金を除く)関連取引	-						
11-6	その他のコモディティ関連取引	-						
11-7	クレジット・デリバティブ取引(カウンター・パーティー・リスク)	-						
	一括清算ネットing 契約による与信相当額削減効果(Δ)	-						
12	長期決済期間取引	-						
13	未決済取引	-						
14	証券化エクスチェンジャーに係る適格流動性補完及び適格なサービス・キャプション・バンス	0~100						
15	上記以外のオフ・バランスの証券化エクスチェンジャー	100						
	リスクアセット計(中央清算機関)			8,161,226	0.00%		8,161,226	0.00%
	リスクアセット計			5,279,944,226	2.34%		5,279,944,226	2.34%

注1) 長期決済期間取引と未決済取引に該当する取引があった場合、算出対象に含まず。

注2) 「派生商品取引」の算出方式は、カレントエクスポージャー方式とします。

注3) 原契約期間が5営業日以内の外国為替関連取引については、与信相当額の算出から除いています。

有価証券等の決済に係る未収金	
オフ・バランス・オフ・バランス リスクアセット計	227,909,312,896
オフ・バランス・オフ・バランス リスクアセット比率 (%/対純資産額)	101.15%

※今後公表されるQ&A等によって、追加項目及び削除項目等が発生する可能性があります。

項目	資産項目	想定元本額			想定元本額		与信相当額	信用リスクアセット	リスクアセット比率 (%/対純資産額)
		1年以内	1年超 5年以内	5年超	ショート・ポジション	ロング・ポジション			
1	外国為替関連取引								
(1)	異種通貨間の金利スワップ								
(2)	為替先渡取引(FXA)								
(3)	先物外国為替取引								
(4)	通貨先物取引								
(5)	通貨オプションの買い								
(6)	通貨オプションの売り								
(7)	その他								
	小計								
2	金利関連取引								
(1)	同一通貨間の金利スワップ								
(2)	金利先渡取引(FRA)								
(3)	金利先物取引								
(4)	金利オプションの買い								
(5)	金利オプションの売り								
(6)	その他								
	小計								
3	金関連取引								
4	株式関連取引	5,271,783,000				5,271,783,000	408,061,300	8,161,226	0.00%
5	貴金属(金を除く)関連取引								
6	その他のコモディティ関連取引								
7	クレジット・デリバティブ取引 (カウンター・パーティー・リスク)								
	一括清算ネットティング契約による与信相当額削減効果(△)								
	合計						408,061,300	8,161,226	0.00%

オプション・ポジション

		想定元本	評価金額
コール	売り		
	買い		
プット	買い		
	売り		

※今後公表されるQ&A等によって、追加項目及び削除項目等が発生する可能性があります。

項目	資産項目	引当率(%)	想定元本額 (信用引当削減効果適用前)		原契約期間が1年以下のコミットメント (20%)	N I F 又は R U F (50%)	原契約期間が1年超のコミットメント (50%)	信用供与に直接的に代替する債券担保を含む経過措置を適用しない元本補てん債証券時、クレジット・デリバティブのクレジット・ポジション提供 (100%)	有価証券の買付、現金若しくは有価証券による担保の提供又は有価証券の買戻条件付売却若しくは充戻条件付購入 (100%)	買戻条件付資産売却又は求償権付資産売却等 (100%)	先物購入、先渡預金、部分払込株式又は部分払込債券 (100%)	証券化引当額-引当額に係る適格流動性担保及び適格な付戻額+引当額-引当額 (0~100%)	上記以外の引当額-引当額の証券化引当額 (100%)
			任意の時期に無条件で取消可能又は自動的に取消可能なコミットメント (0%)	任意の時期に無条件で取消可能又は自動的に取消可能なコミットメント (0%)									
1	現金	0											
2-1	我が国の中央政府及び中央銀行向け	0											
3-1		0											
3-2		20											
3-3	外国の中央政府及び中央銀行向け	50											
3-4		100											
3-5		150											
4	国際決済銀行等向け	0											
5	我が国の地方公共団体向け	0											
6-1		20											
6-2	外国の中央政府等以外の公共部門向け	50											
6-3		100											
6-4		150											
7-1		0											
7-2	国際開発銀行向け	20											
7-3		50											
7-4		100											
7-5		150											
8-1	我が国の政府関係機関向け	10											
8-2		20											
9-1	地方公共団体金融機構向け	10											
9-2		20											
10	地方三公社向け	20											
11-1		20											
11-2	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	50											
11-3		100											
11-4		150											
11-5		250											
12-1		20											
12-2		50											
12-3	法人等向け	100											
12-4		150											
12-5		250											
13	中小企業等向け及び個人向け	75											
14	抵当権付住宅ローン	35											
15-1	不動産取得等事業向け	100											
15-2		150											
16-1		50											
16-2	三月以上延滞等	100											
16-3		150											
17	取立未済手形	20											
18	信用保証協会等による保証付	10											
19	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	10											
20-1	出資等	100											
20-2		250											
21	上記以外	100											
22-1		0~50未満											
22-2	証券化商品(引当額以外)	50~100未満											
22-3		100~350未満											
22-4		350~1250未満											
22-5		1250											
23-1		0~100未満											
23-2	再証券化商品(引当額以外)	100~225未満											
23-3		225~650未満											
23-4		650~1250未満											
23-5		1250											
24-1	複数の資産を裏付とする資産(所謂ファンド)のうち、個々の資産の把握が困難な資産	0~150未満											
24-2		150~350未満											
24-3		350~650未満											
24-4		650~1250未満											
24-5		1250											
52-1	中央清算機関	0									5,271,783,000		
52-2		4											
52-3		4											
52-4		20											
	残高及びリスクアセット計(除く中央清算機関)												
	残高及びリスクアセット計(中央清算機関)										5,271,783,000		
	残高及びリスクアセット計										5,271,783,000		

※今後公表されるQ & A等によって、追加項目及び削除項目等が発生する可能性があります。

CVAリスク相当額（標準的手法）	<input type="text"/>
所要自己資本額	<input type="text"/>
CVAリスク相当額（標準的手法）を8%で除して得た額	<input type="text"/>
CVAリスク相当額（簡便的手法）	<input type="text"/>
CVAリスク相当額（簡便的手法）を8%で除して得た額	<input type="text"/>

派生商品取引の取引相手方	掛目(%)	実効マチュリティ	想定元本	与信相当額	割引現在価値
合計	—	—			

※今後公表されるQ&A等によって、追加項目及び削除項目等が発生する可能性があります。

商品分類	国コード	通貨コード	銘柄コード	ISINコード	銘柄名	統一コード名称	信用付削減効果前			信用付削減効果後			実効残存年数	業種区分	出資区分	他の金融機関等出資区分	投分比率	レバレッジ比率	STC要件	優先劣後区分	アタッチメントポイント	アタッチメントポイント	残高数量	簿価単価 (LOCAL)	簿価金額 (BASE)	評価時価	評価為替	経過利息 (BASE)	前払金残 (BASE)	未収収益 (BASE)	時価合計 (BASE)	OER_個別五7分	統一コード名称		
							資産科目名称	時価合計	リスクウェイト	個別銘柄	資産科目名称	時価合計																						リスクウェイト	個別銘柄
投信	JP	JPY	F41029110	JP2048110000	エヌエフエービー・エス・エヌ	出資等	261,623,800	100	261,623,800	261,623,800	100	261,623,800	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	1,979	127,200	251,779,200	127,200	0	0	0	0	261,623,800	0			
投信	JP	JPY	F41029270	JP2048880003	ソニービルディング・リート・投資法人	出資等	354,226,260	100	354,226,260	354,226,260	100	354,226,260	2,434,260	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	2,792	121,200	338,399,400	126,000	0	0	2,434,260	0	2,434,260	354,226,260	0	
投信	JP	JPY	F41032760	JP2048440008	日本郵船・インフラ・リート・投資法人	出資等	4,415,208,446	100	4,415,208,446	4,415,208,446	100	4,415,208,446	61,168,446	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	6,403	686,000	4,392,458,000	686,000	0	0	61,168,446	0	61,168,446	4,415,208,446	0	
投信	JP	JPY	F41032720	JP2048445000	エヌエフエービー・エス・エヌ	出資等	2,866,267,800	100	2,866,267,800	2,866,267,800	100	2,866,267,800	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	22,857	125,500	2,866,267,800	125,500	0	0	0	0	2,866,267,800	0		
投信	JP	JPY	F41032440	JP2048470005	東武リート・投資法人	出資等	3,959,562,000	100	3,959,562,000	3,959,562,000	100	3,959,562,000	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	22,740	178,100	3,959,562,000	178,100	0	0	0	0	3,959,562,000	0		
投信	JP	JPY	F41032490	JP2048500009	東武リート・投資法人	出資等	4,013,764,400	100	4,013,764,400	4,013,764,400	100	4,013,764,400	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	23,708	164,700	3,994,700,600	169,300	0	0	0	0	4,013,764,400	0		
投信	JP	JPY	F41032690	JP2048160001	フジテレビ・リート・投資法人	出資等	6,561,443,000	100	6,561,443,000	6,561,443,000	100	6,561,443,000	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	18,271	362,000	6,416,274,000	365,000	0	0	0	0	6,561,443,000	0		
投信	JP	JPY	F41032780	JP2048748003	エヌエフエービー・エス・エヌ	出資等	2,668,220,000	100	2,668,220,000	2,668,220,000	100	2,668,220,000	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	11,992	222,600	2,668,220,000	222,600	0	0	0	0	2,668,220,000	0		
投信	JP	JPY	F41032790	JP2048480002	エヌエフエービー・エス・エヌ	出資等	5,503,920,000	100	5,503,920,000	5,503,920,000	100	5,503,920,000	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	9,295	570,000	5,486,418,000	570,000	0	0	0	0	5,503,920,000	0		
投信	JP	JPY	F41032810	JP2048151000	エヌエフエービー・エス・エヌ	出資等	6,880,368,962	100	6,880,368,962	6,880,368,962	100	6,880,368,962	122,954,562	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	47,993	152,900	7,139,179,700	140,800	0	0	122,954,562	0	122,954,562	6,880,368,962	0	
投信	JP	JPY	F41032820	JP2048450004	エヌエフエービー・エス・エヌ	出資等	2,824,096,000	100	2,824,096,000	2,824,096,000	100	2,824,096,000	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	8,023	348,500	2,746,019,500	352,000	0	0	0	0	2,824,096,000	0		
投信	JP	JPY	F41032830	JP2048748003	エヌエフエービー・エス・エヌ	出資等	8,361,172,000	100	8,361,172,000	8,361,172,000	100	8,361,172,000	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	27,688	304,000	8,146,544,000	302,000	0	0	0	0	8,361,172,000	0		
投信	JP	JPY	F41032840	JP2048160001	フジテレビ・リート・投資法人	出資等	1,768,318,520	100	1,768,318,520	1,768,318,520	100	1,768,318,520	179,890,520	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	2,931	291,000	1,792,220,500	159,000	0	0	179,890,520	0	179,890,520	1,768,318,520	0
投信	JP	JPY	F41032810	JP2048151000	エヌエフエービー・エス・エヌ	出資等	6,880,368,962	100	6,880,368,962	6,880,368,962	100	6,880,368,962	7,571,414,400	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	3,003	319,500	859,458,500	339,500	0	0	19,392,252	0	19,392,252	6,880,368,962	0	
投信	JP	JPY	F41032920	JP2048748003	エヌエフエービー・エス・エヌ	出資等	3,231,543,000	100	3,231,543,000	3,231,543,000	100	3,231,543,000	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	20,795	149,800	3,115,091,000	155,400	0	0	0	0	3,231,543,000	0		
投信	JP	JPY	F41032950	JP2048160001	フジテレビ・リート・投資法人	出資等	3,429,363,075	100	3,429,363,075	3,429,363,075	100	3,429,363,075	3,379,411,800	49,951,275	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	16,395	206,000	3,176,144,000	206,000	0	0	49,951,275	0	49,951,275	3,429,363,075	0
投信	JP	JPY	F41032960	JP2048748003	エヌエフエービー・エス・エヌ	出資等	2,935,471,000	100	2,935,471,000	2,935,471,000	100	2,935,471,000	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	6,259	466,000	2,876,484,000	469,000	0	0	0	0	2,935,471,000	0		
投信	JP	JPY	F41032980	JP2048760008	エヌエフエービー・エス・エヌ	出資等	2,746,538,056	100	2,746,538,056	2,746,538,056	100	2,746,538,056	2,699,990,760	46,547,296	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	123,796	21,760	2,693,800,960	21,810,000	0	0	46,547,296	0	46,547,296	2,746,538,056	0
投信	JP	JPY	F41033080	JP2048760008	エヌエフエービー・エス・エヌ	出資等	2,044,107,020	100	2,044,107,020	2,044,107,020	100	2,044,107,020	2,000,156,200	3,950,820	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	934	208,700	1,944,924,000	214,300	0	0	3,950,820	0	3,950,820	2,044,107,020	0
投信	JP	JPY	F41033090	JP2048760008	エヌエフエービー・エス・エヌ	出資等	5,717,880,554	100	5,717,880,554	5,717,880,554	100	5,717,880,554	5,628,669,800	89,414,754	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	56,343	69,800	5,659,241,000	69,800	0	0	89,414,754	0	89,414,754	5,717,880,554	0
投信	JP	JPY	F41034510	JP2048380009	エヌエフエービー・エス・エヌ	出資等	503,035,140	100	503,035,140	503,035,140	100	503,035,140	490,705,500	12,329,640	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	3,543	139,400	493,894,200	138,500	0	0	12,329,640	0	12,329,640	503,035,140	0
投信	JP	JPY	F41034530	JP2048380009	エヌエフエービー・エス・エヌ	出資等	2,257,520,160	100	2,257,520,160	2,257,520,160	100	2,257,520,160	2,214,739,200	42,780,960	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	7,442	288,570	2,147,545,300	297,600	0	0	42,780,960	0	42,780,960	2,257,520,160	0
投信	JP	JPY	F41034550	JP2048761009	エヌエフエービー・エス・エヌ	出資等	570,879,000	100	570,879,000	570,879,000	100	570,879,000	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	4,170	139,500	569,235,000	138,900	0	0	0	0	570,879,000	0		
投信	JP	JPY	F41034590	JP2048760004	エヌエフエービー・エス・エヌ	出資等	469,011,200	100	469,011,200	469,011,200	100	469,011,200	469,011,200	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	3,851	121,100	467,469,200	121,500	0	0	0	0	469,011,200	0	
投信	JP	JPY	F41034820	JP2048110005	エヌエフエービー・エス・エヌ	出資等	12,585,535,841	100	12,585,535,841	12,585,535,841	100	12,585,535,841	17,409,204,500	176,331,341	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	60,093	198,900	11,492,497,000	206,500	0	0	176,331,341	0	176,331,341	12,585,535,841	0
投信	JP	JPY	F41034630	JP2048160000	エヌエフエービー・エス・エヌ	出資等	435,069,600	100	435,069,600	435,069,600	100	435,069,600	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	3,192	120,800	417,872,800	126,300	0	0	0	0	435,069,600	0		
投信	JP	JPY	F41034660	JP2048180008	エヌエフエービー・エス・エヌ	出資等	2,929,487,600	100	2,929,487,600	2,929,487,600	100	2,929,487,600	2,882,834,400	46,653,200	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	17,916	161,700	2,907,017,200	160,800	0	0	46,653,200	0	46,653,200	2,929,487,600	0
投信	JP	JPY	F41034680	JP2048200004	エヌエフエービー・エス・エヌ	出資等	752,691,500	100	752,691,500	752,691,500	100	752,691,500	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	6,305	118,900	769,300,500	117,700	0	0	0	0	752,691,500	0		
投信	JP	JPY	F41034700	JP2048290005	エヌエフエービー・エス・エヌ	出資等	224,689,200	100	224,689,200	224,689,200	100	224,689,200	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	1,657	132,700	219,883,900	135,600	0	0	0	0	224,689,200	0		
投信	JP	JPY	F41034710	JP2048300002	エヌエフエービー・エス・エヌ	出資等	2,137,622,500	100	2,137,622,500	2,137,622,500	100	2,137,622,500	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	4,745	452,000	2,144,740,000	450,500	0	0	0	0	2,137,622,500	0	
投信	JP	JPY	F41034720	JP2048310001	エヌエフエービー・エス・エヌ	出資等	323,798,600	100	323,798,600	323,798,600	100	323,798,600	0	0	0	0																			

商品分類	国コード	通貨コード	銘柄コード	銘柄名 (統一プロト名称・中央清算機関名称)	信用付前払効果前		信用付前払効果後		リソース	個別銘柄与信 相当額	個別玉種 約定日	取引終了日	預資産 銘柄コード	預資産銘柄価 格	GEM 掛目	実効残存 年数	オプションの 区分	再構築コスト	接分比率	レバレッジ 比率	与信相対 関係数	残高数量	簿価単価 (LOCAL)	簿価金額 (BASE)	評価時価	評価為替	経過利息 (BASE)	前払金残 (BASE)	未収収益 (BASE)	時価合計 (BASE)	GEM 個別玉 7ドワン	統一プロト名称	
					想定元本	個別銘柄 与信付金額	想定元本	個別銘柄 与信付金額																									
勘定	JPY		BSP1132000	先物取引買勘定	0	0	0	0		0				0	0%	0		0				0	0.00	5,209,742,000	1.00	1	0	0	0	5,209,742,000	0		
勘定	JPY		BSP1214000	先物取引未払金	0	0	0	0		0				0	0%	0		0				0	0.00	-5,218,824,378	1.00	1	0	0	0	-5,218,824,378	0		
勘定	JPY		BSP1221000	未払収益分配金	0	0	0	0		0				0	0%	0		0				0	0.00	-1,191,194,772	1.00	1	0	0	0	-1,191,194,772	0		
勘定	JPY		BSP1223000	未払委託者報酬	0	0	0	0		0				0	0%	0		0				0	0.00	4,104,491	1.00	1	0	0	0	4,104,491	0		
勘定	JPY		BSP1224000	未払委託者報酬	0	0	0	0		0				0	0%	0		0				0	0.00	-22,692,709	1.00	1	0	0	0	-22,692,709	0		
勘定	JPY		BSP1243003	その他未払費用(監査)	0	0	0	0		0				0	0%	0		0				0	0.00	-374,033	1.00	1	0	0	0	-374,033	0		
勘定	JPY		BSP1243004	その他未払費用(印刷)	0	0	0	0		0				0	0%	0		0				0	0.00	-2,355,177	1.00	1	0	0	0	-2,355,177	0		
勘定	JPY		BSP1243005	その他未払費用(その他1)	0	0	0	0		0				0	0%	0		0				0	0.00	-596,128	1.00	1	0	0	0	-596,128	0		
勘定	JPY		BSP1243006	その他未払費用(その他2)	0	0	0	0		0				0	0%	0		0				0	0.00	-240,960	1.00	1	0	0	0	-240,960	0		
勘定	JPY		1132006100000000	委託証拠金	0	775,914	0	775,914		38,795,690				0	0%	0		38,795,690				0	0.00	38,795,690	1.00	1	0	0	0	38,795,690	0	三菱UFJモルガン・スタンレー証券	
先物	JPY		000036 1912	東証REIT先物先物	387,433,500	387,433,500	387,433,500	387,433,500	100	387,433,500	2019/09/09	2019/12/13		0	0%	0	117808219	M				0	173	2,212.00	0	2,239.50	1	0	0	0	19,977,762	0	三菱UFJモルガン・スタンレー証券
先物	JPY		000036 1912	東証REIT先物先物	223,950,000	223,950,000	223,950,000	223,950,000	100	223,950,000	2019/09/27	2019/12/13		0	0%	0	117808219	M				0	100	2,212.00	0	2,239.50	1	0	0	0	6,832,840	0	三菱UFJモルガン・スタンレー証券
先物	JPY		000036 1912	東証REIT先物先物	4,380,462,000	4,380,462,000	4,380,462,000	4,380,462,000	100	4,380,462,000	2019/10/10	2019/12/13		0	0%	0	117808219	M				0	1,956	2,212.00	0	2,239.50	1	0	0	0	25,404,528	0	三菱UFJモルガン・スタンレー証券
先物	JPY		000036 1912	東証REIT先物先物	279,937,500	279,937,500	279,937,500	279,937,500	100	279,937,500	2019/10/30	2019/12/13		0	0%	0	117808219	M				0	125	2,233.55	0	2,239.50	1	0	0	0	743,500	0	三菱UFJモルガン・スタンレー証券
先物	JPY		000036 1912	東証REIT先物先物	387,433,500	864,475	387,433,500	864,475	2	43,223,772	2019/09/09	2019/12/13		0	6%	0	117808219	L				0	19	977.762	0	2,239.50	1	0	0	19,977,762	23,246,010	三菱UFJモルガン・スタンレー証券	
先物	JPY		000036 1912	東証REIT先物先物	223,950,000	405,397	223,950,000	405,397	2	20,269,840	2019/09/27	2019/12/13		0	6%	0	117808219	L				0	100	2,212.00	0	2,239.50	1	0	0	6,832,840	13,437,000	三菱UFJモルガン・スタンレー証券	
先物	JPY		000036 1912	東証REIT先物先物	4,380,462,000	5,764,645	4,380,462,000	5,764,645	2	289,232,248	2019/10/10	2019/12/13		0	6%	0	117808219	L				0	1,956	2,212.00	0	2,239.50	1	0	0	25,404,528	262,927,729	三菱UFJモルガン・スタンレー証券	
先物	JPY		000036 1912	東証REIT先物先物	279,937,500	350,795	279,937,500	350,795	2	17,539,750	2019/10/30	2019/12/13		0	6%	0	117808219	L				0	125	2,233.55	0	2,239.50	1	0	0	743,500	16,796,250	三菱UFJモルガン・スタンレー証券	