

投資信託資産構成内容
(パーゼル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 日経225

設定日	2019年02月05日
基準日	2022年07月29日
総口数	6,612,840
基準価額	28,274 (円)
純資産額	186,970,945,854 (円)

元本通貨
為替レート

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	リカバイト (%)	リカバイトの加重平均 (%)	信用リカバイト削減効果前			信用リカバイト削減効果後		
				資産の額 (時価金額)	信用リカバイトの額	リスクアセット比率 (%/対純資産額)	資産の額 (時価金額)	信用リカバイトの額	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		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		50							
6-3		100							
6-4		150							
7-1		0							
7-2		20							
7-3		50							
7-4		100							
7-5		150							
8-1		10							
8-2		20							
9-1		10							
9-2		20							
10	地方三公社向け	20							
11-1		20		6,353,789,707	1,270,757,941	0.68%	6,353,789,707	1,270,757,941	0.68%
11-2		50							
11-3		100							
11-4		150							
11-5		250							
12-1		20							
12-2		50							
12-3		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		100							
15-2		150							
16-1		50							
16-2		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		100		180,586,461,760	180,586,461,760	96.59%	180,586,461,760	180,586,461,760	96.59%
20-2		250							
21	上記以外	100							
22-1		0~50未満							
22-2		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		100~225未満							
23-3		225~650未満							
23-4		650~1250未満							
23-5		1250							
24-1		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		0							
52-2		2							
52-3		4							
52-4		20							
資産の額計				186,940,251,467			186,940,251,467		
リスクアセット計					181,857,219,701	97.26%		181,857,219,701	97.26%
金融機関出資計 (時価金額)				4,450,468,040	TLAC関連調達手段				
					適格旧非累積的永久優先株				
					適格旧資本調達手段				
					その他				

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「パーゼル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、パ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、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)

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・デリバティブのワシントン提供)	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	6,382,500,000	6,382,500,000	3.41%	6,382,500,000	6,382,500,000	3.41%
11	派生商品取引	-	6,382,500,000	16,335,929	0.01%	6,382,500,000	16,335,929	0.01%
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	-	6,382,500,000	16,335,929	0.01%	6,382,500,000	16,335,929	0.01%
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	証券化エクスポージャーに係る適格流動性補完及び適格なサービサーキャプション	0~100						
15	上記以外のオフ・バランスの証券化エクスポージャー	100						
	リスクアセット計(中央清算機関)			16,335,929	0.01%		16,335,929	0.01%
	リスクアセット計			6,398,835,929	3.42%		6,398,835,929	3.42%

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、算出対象に含みます。
 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 リスクアセット計	188,256,055,630
オフ・バランス リスクアセット比率 (%/対純資産額)	100.69%

※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	6,382,500,000				6,382,500,000	816,796,460	16,335,929	0.01%
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						816,796,460	16,335,929	0.01%

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)															
			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%)	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増進措置を適用しない完備でん債証券時、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等 (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%)	証券化ワレオ・ブローに係る適格流動性提供及び適格なデリバティブ・ワレオ (0~100%)	上記以外のワレオ・バウンスの証券化ワレオ (100%)				
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	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		50																
11-3	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	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		50~100未満																
22-3	証券化商品(ワレオ・バウンス以外)	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(ワレオ・バウンス以外)	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		0																
52-2	中央清算機関	4												6,382,500,000				
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)													6,382,500,000				
	残高及びリスクアセット計													6,382,500,000				

※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。

商品分類	国コード	通貨コード	銘柄コード	銘柄名	銘柄名 (統一プロトコル名称 (統一プロトコル名称・中央清算機関名称))	資産科目名称	信用リスク削減効果		信用リスク削減効果		エクイティ	個別銘柄と信 相当額	個別建玉 約定日	取引終了 日	原資産 銘柄コー ド	原資産銘柄価 格	アドオン 換目	実効マ チュ リティ	ボタンの区 分	再構築コ ス	投分比率	レバレッ ジ比率	与信相当 額係数	クレジット BICコード	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)	前払金額 (BASE)	未収収益 (BASE)	時価合計 (BASE)	CEM 個別 玉7d 分	統一プロトコル名称	
							想定元本	個別銘柄 リスク削減額	想定元本	個別銘柄 リスク削減額																										
勘定		JPY	BSP1132000	先物取引買勘定		集計対象外(オフ)	0	0	0	0	0				0	0%	0	L	0	0			1	1	0	0.00	6,489,280,600	1.00	1	0	0	6,489,280,600	0			
勘定		JPY	BSP1214000	先物取引未払金		集計対象外(オフ)	0	0	0	0	0				0	0%	0	L	0	0			1	1	0	0.00	-4,489,280,600	1.00	1	0	0	-4,489,280,600	0			
勘定		JPY	BSP1223000	未払委託者報酬		集計対象外(オフ)	0	0	0	0	0				0	0%	0	L	0	0			1	1	0	0.00	-42,680,490	1.00	1	0	0	-42,680,490	0			
勘定		JPY	BSP1224000	未払委託者報酬		集計対象外(オフ)	0	0	0	0	0				0	0%	0	L	0	0			1	1	0	0.00	-72,556,774	1.00	1	0	0	-72,556,774	0			
勘定		JPY	BSP1242000	貸入委託証券金代用有価証券		集計対象外(オフ)	0	0	0	0	0				0	0%	0	L	0	0			1	1	0	0.00	-98,700,000	1.00	1	0	0	-98,700,000	0			
勘定		JPY	BSP1243000	その他未払費用(監査)		集計対象外(オフ)	0	0	0	0	0				0	0%	0	L	0	0			1	1	0	0.00	-935,000	1.00	1	0	0	-935,000	0			
勘定		JPY	BSP1243004	その他未払費用(印刷)		集計対象外(オフ)	0	0	0	0	0				0	0%	0	L	0	0			1	1	0	0.00	-21,074,194	1.00	1	0	0	-21,074,194	0			
勘定		JPY	BSP1243005	その他未払費用(その他1)		集計対象外(オフ)	0	0	0	0	0				0	0%	0	L	0	0			1	1	0	0.00	-7,052,932	1.00	1	0	0	-7,052,932	0			
勘定		JPY	BSP1243006	その他未払費用(その他2)		集計対象外(オフ)	0	0	0	0	0				0	0%	0	L	0	0			1	1	0	0.00	-4,743,617	1.00	1	0	0	-4,743,617	0			
投資金	JP	JPY	11132001000000000000	代行者信託証券株式会社	日本証券クリアリング機構	現金 株式関連取引	0	3,208,000	0	3,208,000	2	160,400,000	2019/02/06			0	0%	0	L	0			1	1	2,000	49,359,000	98,700,000	78,890,000	1	0	0	160,400,000	0	三菱UFJモルガン・スタンレー証券		
投資金	JP	JPY	11132000910000000000	委託証券金	日本証券クリアリング機構	現金 株式関連取引	0	5,330,360	0	5,330,360	2	266,518,000				0	0%	0	L	0			1	1	1	JSCCJPJ1	266,518,000	1.00	266,518,000	1.00	1	0	0	266,518,000	0	三菱UFJモルガン・スタンレー証券
先物		JPY	000040_2209	日経平均株価指数先物		先物購入、先物買値、部分払込株式又は部分払込債権	6,188,250,000	6,188,250,000	6,188,250,000	6,188,250,000	100	6,188,250,000	2022/06/08	2022/09/09		0	0%	0	M	0			1	1	223	28,170,222	0	27,750,000	1	0	0	-43,708,060	0			
先物		JPY	000040_2209	日経平均株価指数先物		先物購入、先物買値、部分払込株式又は部分払込債権	194,250,000	194,250,000	194,250,000	194,250,000	100	194,250,000	2022/06/29	2022/09/09		0	0%	0	M	0			1	1	7	26,760,222	0	27,750,000	1	0	0	6,928,460	0			
先物	JP	JPY	000040_2209	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	現金 株式関連取引	6,188,250,000	7,425,900	6,188,250,000	7,425,900	2	371,295,000	2022/06/08	2022/09/09		0	6%	0	L	0			1	1	JSCCJPJ1	223	28,170,222	0	27,750,000	1	0	0	-43,708,060	271,295,000	三菱UFJモルガン・スタンレー証券	
先物	JP	JPY	000040_2209	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	現金 株式関連取引	194,250,000	371,669	194,250,000	371,669	2	18,583,460	2022/06/29	2022/09/09		0	6%	0	L	6,928,460			1	1	JSCCJPJ1	7	26,760,222	0	27,750,000	1	0	0	6,928,460	11,655,000	三菱UFJモルガン・スタンレー証券	