

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 日経225

設定日	2019年02月05日
基準日	2019年10月31日
総口数	2,484,570
基準価額	23,151 (円)
純資産額	57,519,162,976 (円)

リスクスルー適用区分	計算対象外
元本通貨	JPY
為替レート	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		50							
3-4	外国の中央政府及び中央銀行向け	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	外国の中央政府等以外の公共部門向け	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		1,069,715,277	213,943,055	0.37%	1,069,715,277	213,943,055	0.37%
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		56,463,993,980	56,463,993,980	98.17%	56,463,993,980	56,463,993,980	98.17%
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、	150~350未満							
24-3	個々の資産の把握が困難な資産	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				57,533,709,257			57,533,709,257		
リスクアセット計					56,677,937,035	98.54%		56,677,937,035	98.54%
金融機関出資計(時価金額)		対象普通株式等		1,227,429,180	ILAC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「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おりません。

※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なりません。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。

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・デリバティブのクレジット提供)	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	1,468,800,000	1,468,800,000	2.55%	1,468,800,000	1,468,800,000	2.55%
11	派生商品取引	-	1,468,800,000	6,286,283	0.01%	1,468,800,000	6,286,283	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	-	1,468,800,000	6,286,283	0.01%	1,468,800,000	6,286,283	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)	-						
一括清算クレジット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ス・キャプチャードバンス 上記以外のオフ・バランスの証券化エクスポージャー	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)				6,286,283	0.01%		6,286,283	0.01%
リスクアセット計				1,475,086,283	2.56%		1,475,086,283	2.56%

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 リスクアセット計	58,153,023,318
オフ・バランス リスクアセット比率(対純資産額)	101.10%

※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	1,468,800,000				1,468,800,000	314,314,176	6,286,283	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						314,314,176	6,286,283	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)		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建ての債権類、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%)	証券化引当額-引当額に係る適格流動性補填及び適格なデリバティブポジション (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									1,468,800,000		
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)										1,468,800,000		
	残高及びリスクアセット計										1,468,800,000		

※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。

Table with columns: 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, 統一プロパー名称, 資産科目名称, 時価合計, リスクウェイト, 個別銘柄時価, リスクウェイト, 資産科目名称, 時価合計, リスクウェイト, 個別銘柄時価, リスクウェイト, 純資産合計, 純資産比率, 純資産前払費用, 実効残存年数, 業種区分, 区分区分, 株の金融機関等出資区分, 投票比率, 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), 簿価単価 (BASE), 評価金額, 評価変動, 経過利益 (BASE), 前払金残 (BASE), 未収収益 (BASE), 時価合計 (BASE), OER, 個別7つワ, 統一プロパー名称

商品分類	国コード	通貨コード	銘柄コード	銘柄名	銘柄名 (統一プロト名称・中央清算機関名称)	信用初期調整前		信用初期調整後		リソース	個別銘柄と信 相当額	個別玉額 約定日	取引終了日	資産 銘柄コード	資産 銘柄コード	GEM 掲目	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 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 7ドワン金額	想定元本	個別銘柄 7ドワン金額																										
勘定	JPY	BSP1	132000	先物取引買勘定		0	0	0	0		0					0%	0						0	0.00	1,376,713.824	1.00	1	0	0	0	1,376,713.824	0			
勘定	JPY	BSP1	214000	先物取引未払金		0	0	0	0		0					0%	0						0	0.00	-1,376,713.824	1.00	1	0	0	0	-1,376,713.824	0			
勘定	JPY	BSP1	223000	未払委託者報酬		0	0	0	0		0					0%	0						0	0.00	-6,557.127	1.00	1	0	0	0	-6,557.127	0			
勘定	JPY	BSP1	224000	未払委託者報酬		0	0	0	0		0					0%	0						0	0.00	11,147.094	1.00	1	0	0	0	11,147.094	0			
勘定	JPY	BSP1	242000	差入委託証券代行有価証券		0	0	0	0		0					0%	0						0	0.00	-98,700.000	1.00	1	0	0	0	-98,700.000	0			
勘定	JPY	BSP1	243003	その他未払費用(雑費)		0	0	0	0		0					0%	0						0	0.00	-393.402	1.00	1	0	0	0	-393.402	0			
勘定	JPY	BSP1	243004	その他未払費用(印画)		0	0	0	0		0					0%	0						0	0.00	-3,269.670	1.00	1	0	0	0	-3,269.670	0			
勘定	JPY	BSP1	243005	その他未払費用(その他1)		0	0	0	0		0					0%	0						0	0.00	-205.164	1.00	1	0	0	0	-205.164	0			
証拠金	JPY	11520010000009983		代用有価証券株式	日本証券クリアリング機構	0	2,682,000	0	2,682,000	2	134,100,000	2019/02/06				0%	0		134,100,000				0	2.000	49,350.000	98,700,000	66,190.00	1	0	0	134,100,000	0		三菱UFJモルガン・スタンレー証券	
証拠金	JPY	1152001000000000		委託証拠金	日本証券クリアリング機構	0	0	0	0		0					0%	0						0	-85,060.000	-85,060.000	1.00	1	0	0	0	-85,060.000	0		三菱UFJモルガン・スタンレー証券	
先物	JPY	000040	1912	日経平均株価先物	先物購入・空渡買取・部分払戻金株式先物先物先物先物	1,032,750,000	1,032,750,000	1,032,750,000	1,032,750,000	100	1,032,750,000	2019/09/11	2019/12/13			0%	0	117808219					0	45	21,410.21	0	22,950.00	1	0	0	69,290,280	0		三菱UFJモルガン・スタンレー証券	
先物	JPY	000040	1912	日経平均株価先物	先物購入・空渡買取・部分払戻金株式先物先物先物先物	436,050,000	436,050,000	436,050,000	436,050,000	100	436,050,000	2019/09/27	2019/12/13			0%	0	117808219						0	19	21,750.21	0	22,950.00	1	0	0	22,795,896	0		三菱UFJモルガン・スタンレー証券
先物	JPY	000040	1912	日経平均株価先物	日本証券クリアリング機構	1,032,750,000	2,625,106	1,032,750,000	2,625,106	2	131,255,280	2019/09/11	2019/12/13			0%	0	117808219					0	45	21,410.21	0	22,950.00	1	0	0	69,290,280	61,965,000		三菱UFJモルガン・スタンレー証券	
先物	JPY	000040	1912	日経平均株価先物	日本証券クリアリング機構	436,050,000	979,178	436,050,000	979,178	2	48,958,896	2019/09/27	2019/12/13			0%	0	117808219					0	19	21,750.21	0	22,950.00	1	0	0	22,795,896	26,163,000		三菱UFJモルガン・スタンレー証券	