

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 S&P500 (為替ヘッジあり) |                   |
| 設定日                        | 2023年09月21日       |
| 基準日                        | 2024年03月29日       |
| 総口数                        | 2,915,000         |
| 基準価額                       | 232,589 (円)       |
| 純資産額                       | 6,779,955,143 (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         |                | 310,885,839   | 62,177,167    | 0.92%               | 310,885,839   | 62,177,167    | 0.92%               |
| 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        |                | 6,492,716,341 | 6,492,716,341 | 95.76%              | 6,492,716,341 | 6,492,716,341 | 95.76%              |
| 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          |                        |            |                | 6,803,602,180 |               |                     | 6,803,602,180 |               |                     |
| リスクアセット計       |                        |            |                |               | 6,554,893,508 | 96.68%              |               | 6,554,893,508 | 96.68%              |
| 金融機関出資計 (時価金額) |                        |            |                | 853,930,552   | 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エ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     | 334,322,733   | 334,322,733 | 4.93%               | 334,322,733   | 334,322,733 | 4.93%               |
| 11   | 派生商品取引  | -       | 7,073,587,708 | 21,747,763  | 0.32%               | 7,073,587,708 | 21,747,763  | 0.32%               |
| 11-1 | 外国為替関連取引  | -       | 6,739,264,975 | 20,275,522  | 0.30%               | 6,739,264,975 | 20,275,522  | 0.30%               |
| 11-2 | 金利関連取引  | -       |               |             |                     |               |             |                     |
| 11-3 | 金関連取引   | -       |               |             |                     |               |             |                     |
| 11-4 | 株式関連取引  | -       | 334,322,733   | 1,472,241   | 0.02%               | 334,322,733   | 1,472,241   | 0.02%               |
| 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ビサーキャッシュ・アドバンス           | 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)                                    |         |               | 1,472,241   | 0.02%               |               | 1,472,241   | 0.02%               |
|      | リスクアセット計  |         |               | 356,070,496 | 5.25%               |               | 356,070,496 | 5.25%               |

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、算出対象に含まれます。

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                      | 532,709       |
| オフ・バランス・オフ・バランス リスクアセット計            | 6,910,964,004 |
| 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) | 101.93%       |

※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<br>(%/対純資産額) |
|-----|-------------------------------------|---------------|-------------|-----|---------------|-------------|-------------|------------|------------------------|
|     |                                     | 1年以内          | 1年超<br>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                            | 6,739,264,975 |             |     | 6,739,264,975 |             | 101,377,612 | 20,275,522 | 0.30%                  |
| (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                                  | 6,739,264,975 |             |     | 6,739,264,975 |             | 101,377,612 | 20,275,522 | 0.30%                  |
| 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                              | 334,322,733   |             |     |               | 334,322,733 | 73,612,099  | 1,472,241  | 0.02%                  |
| 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<br>(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                                  |               |             |     |               |             | 174,989,711 | 21,747,763 | 0.32%                  |

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増進措置を適用しない元本額でん債証券時、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%) | 証券化引当額に係る適格流動性補填及び適格な付加額 (0~100%) | 上記以外の引当額 (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 | 証券化商品及び不良債権証券化商品 (リジネータ以外)                | 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 (リジネータ以外)                          | 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          |                                       |                                       |                          |                      |                         |   |  |                             | 334,322,733                     |                                   |                 |
| 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)                     |            |                                       |                                       |                          |                      |                         |   |  |                             | 334,322,733                     |                                   |                 |
|      | 残高及びリスクアセット計                              |            |                                       |                                       |                          |                      |                         |   |  |                             | 334,322,733                     |                                   |                 |

※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。







