

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 NASDAQ100 (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 | 800,000 |
| 基準価額 | 236,257 (円) |
| 純資産額 | 1,890,057,957 (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 | | 27,902,030 | 5,580,406 | 0.30% | 27,902,030 | 5,580,406 | 0.30% |
| 11-2 | | 50 | | | | | | | |
| 11-3 | | 100 | 20.00% | | | | | | |
| 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 | 100.00% | 1,860,703,401 | 1,860,703,401 | 98.45% | 1,860,703,401 | 1,860,703,401 | 98.45% |
| 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 | | | | 1,888,605,431 | | | 1,888,605,431 | | |
| リスクアセット計 | | | | | 1,866,283,807 | 98.74% | | 1,866,283,807 | 98.74% |
| 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 | | 9,657,545 | 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「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 | 45,652,864 | 45,652,864 | 2.42% | 45,652,864 | 45,652,864 | 2.42% |
| 11 | 派生商品取引 | - | 1,923,611,171 | 6,146,434 | 0.33% | 1,923,611,171 | 6,146,434 | 0.33% |
| 11-1 | 外国為替関連取引 | - | 1,877,958,307 | 5,649,961 | 0.30% | 1,877,958,307 | 5,649,961 | 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 | - | 45,652,864 | 496,473 | 0.03% | 45,652,864 | 496,473 | 0.03% |
| 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・アパンス | 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) | | | 496,473 | 0.03% | | 496,473 | 0.03% |
| | リスクアセット計 | | | 51,799,298 | 2.74% | | 51,799,298 | 2.74% |

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・オフ・バランス リスクアセット計 | 1,918,083,105 |
| 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) | 101.48% |

※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 | 1,877,958,307 | | | 1,877,958,307 | | 28,249,806 | 5,649,961 | 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 | 1,877,958,307 | | | 1,877,958,307 | | 28,249,806 | 5,649,961 | 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 | 45,652,864 | | | | 45,652,864 | 24,823,692 | 496,473 | 0.03% |
| 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 | | | | | | 53,073,498 | 6,146,434 | 0.33% |

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。

| 商品分類 | 国コード | 通貨コード | 銘柄コード | 銘柄名 | 銘柄コード・名称 (統一プロダクト名称・中央清算機関名称) | 信用付短期証券 | | 信用付長期証券 | | リターン | 個別銘柄与信 相関係数 | 個別建玉 約定日 | 取引終了 日 | 証券種 別コード | 原資産銘柄価 格 | アドオン 積立 | 売却マ チ、 リタイ | ポジション 区分 | 再構築コ スト | 控分比率 | レバレッ ジ比率 | 身価相 当率 | ポジション 別(コ スト) | 株数数量 | 簿価単価 (LOCAL) | 簿価金額 (BASE) | 評価時価 | 評価為替 | 経過利息 (BASE) | 前払金積 (BASE) | 未収収益 (BASE) | 時価合計 (BASE) | CEM 個別 玉打込 | 統一プロダクト名称 | | |
|------|------|-------|-------------------|--------------|----------------------------------|---------------|------------------|---------------|------------------|------------|----------------|-------------|------------|-------------|-------------|------------|------------------|-------------|------------|------------|-------------|-----------|---------------------|------|-----------------|----------------|----------------|-----------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------|--|--|
| | | | | | | 想定元本 | 取得元本 %1978118 | 想定元本 | 取得元本 %1978118 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 勘定 | JPT | | BSP1131000 | 買為替 | | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | | 0 | 0% | 0 | L | | 0 | 27.09168794 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0.00 | 111,215 | 1.00 | 1 | 0 | 0 | 0 | 111,215 | 0 | | |
| 勘定 | JPT | | BSP1142000 | 為替未収入金 | | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | | 0 | 0% | 0 | L | | 0 | 100 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0.00 | 1,877,888.297 | 1.00 | 1 | 0 | 0 | 0 | 1,877,888.297 | 0 | | |
| 勘定 | JPT | | BSP1211099 | 未払金(その他) | | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | | 0 | 0% | 0 | L | | 0 | 100 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0.00 | 17,530.878 | 1.00 | 1 | 0 | 0 | 0 | 17,530.878 | 0 | | |
| 勘定 | JPT | | BSP1212000 | 為替未払金 | | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | | 0 | 0% | 0 | L | | 0 | 100 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0.00 | -111,215 | 1.00 | 1 | 0 | 0 | 0 | -111,215 | 0 | | |
| 勘定 | JPT | | BSP1222000 | 未払金(その他) | | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | | 0 | 0% | 0 | L | | 0 | 100 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0.00 | -400,738 | 1.00 | 1 | 0 | 0 | 0 | -400,738 | 0 | | |
| 勘定 | JPT | | BSP1223000 | 未払委託者報酬 | | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | | 0 | 0% | 0 | L | | 0 | 100 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0.00 | -239,513 | 1.00 | 1 | 0 | 0 | 0 | -239,513 | 0 | | |
| 勘定 | JPT | | BSP1224000 | 未払委託者報酬 | | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | | 0 | 0% | 0 | L | | 0 | 100 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0.00 | -1,361,183 | 1.00 | 1 | 0 | 0 | 0 | -1,361,183 | 0 | | |
| 勘定 | JPT | | BSP1243003 | その他未払費用(証券) | | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | | 0 | 0% | 0 | L | | 0 | 100 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0.00 | -23,859 | 1.00 | 1 | 0 | 0 | 0 | -23,859 | 0 | | |
| 勘定 | JPT | | BSP1243004 | その他未払費用(印刷) | | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | | 0 | 0% | 0 | L | | 0 | 100 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0.00 | -580,568 | 1.00 | 1 | 0 | 0 | 0 | -580,568 | 0 | | |
| 勘定 | JPT | | BSP1243006 | その他未払費用(その他) | | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | | 0 | 0% | 0 | L | | 0 | 100 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0.00 | -578,908 | 1.00 | 1 | 0 | 0 | 0 | -578,908 | 0 | | |
| 勘定 | JPT | | BSP1251000 | 買為替 | | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | | 0 | 0% | 0 | L | | 0 | 100 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0.00 | -1,877,888.297 | 1.00 | 1 | 0 | 0 | 0 | -1,877,888.297 | 0 | | |
| 勘定 | USD | | BSP1132000 | 先物取引買勘定 | | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | | 0 | 0% | 0 | L | | 0 | 100 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0.00 | 48,210,421 | 1.00 | 151.41 | 0 | 0 | 0 | 48,210,421 | 0 | | |
| 勘定 | USD | | BSP1144000 | 先物取引買勘定 | | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | | 0 | 0% | 0 | L | | 0 | 100 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0.00 | 48,210,421 | 1.00 | 151.41 | 0 | 0 | 0 | 48,210,421 | 0 | | |
| 勘定 | USD | | BSP1152001 | 法人委託証券(現金) | シカゴ商業取引所 | 0 | 432,842 | 0 | 432,842 | 21,642.078 | | | | | 0 | 0% | 0 | L | | 21,642.078 | 27.09168794 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0.00 | 21,642.078 | 1.00 | 151.41 | 0 | 0 | 0 | 21,642.078 | 0 | Societe Generale International Limited | |
| 先物 | USD | | 09198811.2408.030 | NAS MIN 2406 | 先物購入、先物売却、部分商品種別又は部分商品種別 | 4,150,260 | 4,150,260 | 4,150,260 | 4,150,260 | 100 | | 2024/03/11 | 2024/06/21 | NRB | 0 | 0% | 0 | S | 230136986 | 0 | 0 | 1 | 1 | 0 | 0 | 18,296.45 | 0 | 18,475.00 | 151.41 | 0 | 0 | 0 | 40,109 | 0 | | |
| 先物 | USD | | 09198811.2408.030 | NAS MIN 2406 | 先物購入、先物売却、部分商品種別又は部分商品種別 | 41,502,604 | 41,502,604 | 41,502,604 | 41,502,604 | 100 | | 2024/03/11 | 2024/06/21 | NRB | 0 | 0% | 0 | S | 230136986 | 0 | 0 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0 | 18,296.45 | 0 | 18,475.00 | 151.41 | 0 | 0 | 0 | 402,333 | 0 | |
| 先物 | USD | | 09198811.2408.030 | NAS MIN 2406 | シカゴ商業取引所 | 4,150,260 | 4,150,260 | 4,150,260 | 4,150,260 | 100 | | 2024/03/11 | 2024/06/21 | NRB | 0 | 0% | 0 | S | 230136986 | 0 | 0 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0 | 18,296.45 | 0 | 18,475.00 | 151.41 | 0 | 0 | 0 | 40,109 | 249,016 | Societe Generale International Limited |
| 先物 | USD | | 09198811.2408.030 | NAS MIN 2406 | シカゴ商業取引所 | 41,502,604 | 41,502,604 | 41,502,604 | 41,502,604 | 100 | | 2024/03/11 | 2024/06/21 | NRB | 0 | 0% | 0 | S | 230136986 | 0 | 0 | 1 | 1 | 0 | 0 | 0 | 18,296.45 | 0 | 18,475.00 | 151.41 | 0 | 0 | 0 | 402,333 | 2,490,156 | Societe Generale International Limited |
| 為替予約 | JP | | 5000120240461 | 株式会社 三菱UFJ銀行 | 為替予約 | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | | | 0 | 0% | 0 | S | 098219178 | 0 | 0 | 1 | 1 | 0 | 0 | 151.41 | 0 | 151.44 | 151.3378 | 0 | 0 | 0 | - | 0 | 株式会社 三菱UFJ銀行 | |
| 為替予約 | JP | | 5000120240502 | 三菱UFJ銀行株式会社 | 為替予約 | 1,877,958.307 | 5,649,961 | 1,877,958.307 | 5,649,961 | 20 | | 2024/03/29 | 2024/05/02 | | 0 | 1% | 0 | S | 09150685 | 0 | 53.621 | 100 | 1 | 1 | 0 | -12,470.000 | 150.60 | 0 | 150.59 | 150.5938 | 0 | 0 | 0 | 53,621 | 18,779,583 | 三菱UFJ銀行株式会社 |