

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 DAX (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	640,000
基準価額	230,655 (円)
純資産額	1,476,189,353 (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		21,050,290	4,210,058	0.29%	21,050,290	4,210,058	0.29%
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		1,432,787,854	1,432,787,854	97.06%	1,432,787,854	1,432,787,854	97.06%
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				1,453,838,144			1,453,838,144		
リスクアセット計					1,436,997,912	97.35%		1,436,997,912	97.35%

金融機関出資計 (時価金額)	対象普通株式等	275,168,607	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	45,974,913	45,974,913	3.11%	45,974,913	45,974,913	3.11%
11	派生商品取引	-	1,514,067,545	5,075,929	0.35%	1,514,067,545	5,075,929	0.35%
11-1	外国為替関連取引	-	1,468,092,632	4,404,277	0.30%	1,468,092,632	4,404,277	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	-	45,974,913	671,652	0.05%	45,974,913	671,652	0.05%
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セビサー・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)			671,652	0.05%		671,652	0.05%
	リスクアセット計			51,050,842	3.46%		51,050,842	3.46%

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	1,488,048,754
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)	100.80%

※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	1,468,092,632			1,468,092,632		22,021,389	4,404,277	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	1,468,092,632			1,468,092,632		22,021,389	4,404,277	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	45,974,913				45,974,913	33,582,606	671,652	0.05%
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						55,603,995	5,075,929	0.35%

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	契約割合 (%)	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返済可能又は自動的に返済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元本超過の保証契約、クレジット・デリバティブの提供(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%)	証券化ワレット・ブローカーによる適格流動性提供及び適格なデレター・リファクタリング (0~100%)	上記以外のワレット・ブローカーの証券化ワレット (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		100												
15-2	不動産取得等事業向け	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	証券化商品及び不良債権証券化商品(リジネータ以外)	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(リジネータ以外)	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、	0~150未満												
24-2		150~350未満												
24-3		350~650未満												
24-4	個々の資産の把握が困難な資産	650~1250未満												
24-5		1250												
52-1		0												
52-2		4										45,974,913		
52-3	中央清算機関	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)											45,974,913		
	残高及びリスクアセット計											45,974,913		

※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。



ファンド名称： N2M 上場投信 DAX (為替ヘッジあり)  
 基準年月日： 2024/3/29

オフバランス商品の銘柄別内訳 (単位：一通貨単位)

商品分類	国コード	通貨コード	銘柄コード	銘柄名	銘柄コード名等 (統一プロコード名称・中央清算機関名称)	資産科目名称	信用対価調整前		信用対価調整後		クレジット	個別銘柄与信 相商額	個別建玉 約定日	取引終了 日	運用資産 銘柄コード	原資産銘柄価 格	アドオン 積立	売却マ チス リタイ	ポジション別 分	再構築コ スト	按分比率	レバレッ ジ比率	外債相 種数	ポジション 別(コ スト)	株数数量	準備単価 (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)	CEM_個別 玉打込	統一プロコード名称
							想定元本	信用対価 調整前	想定元本	信用対価 調整後																									
勘定	EUR	BSP122000	先物取引買勘定			集計対象外(オフ)	0	0	0		0				0	0%	0	0	100		1	1		0	0.00	44,121,323	1.00	163.24	0	0	0	44,121,323	0		
勘定	EUR	BSP1214000	先物取引未払金			集計対象外(オフ)	0	0	0		0				0	0%	0	0	100		1	1		0	0.00	-4,121,323	1.00	163.24	0	0	0	-4,121,323	0		
勘定	JPY	BSP142000	為替未収入金			集計対象外(オフ)	0	0	0		0				0	0%	0	0	100		1	1		0	0.00	1,488,992,632	1.00	0	0	0	0	1,488,992,632	0		
勘定	JPY	BSP1211000	未払金(その他)			集計対象外(オフ)	0	0	0		0				0	0%	0	0	100		1	1		0	0.00	-1,994,843	1.00	1	0	0	0	-1,994,843	0		
勘定	JPY	BSP122000	未払委託者報酬			集計対象外(オフ)	0	0	0		0				0	0%	0	0	100		1	1		0	0.00	-63,788	1.00	1	0	0	0	-63,788	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	100		1	1		0	0.00	-510,135	1.00	1	0	0	0	-510,135	0		
勘定	JPY	BSP1243003	その他未払費用(雑金)			集計対象外(オフ)	0	0	0		0				0	0%	0	0	100		1	1		0	0.00	-8,522	1.00	1	0	0	0	-8,522	0		
勘定	JPY	BSP1243004	その他未払費用(印類)			集計対象外(オフ)	0	0	0		0				0	0%	0	0	100		1	1		0	0.00	-383,470	1.00	1	0	0	0	-383,470	0		
勘定	JPY	BSP1243006	その他未払費用(その他)			集計対象外(オフ)	0	0	0		0				0	0%	0	0	100		1	1		0	0.00	-338,040	1.00	1	0	0	0	-338,040	0		
勘定	JPY	BSP1251000	売掛金			集計対象外(オフ)	0	0	0		0				0	0%	0	0	100		1	1		0	0.00	1,488,992,632	1.00	1	0	0	0	1,488,992,632	0		
勘定	DE	BSP1152001	売入委託証券(雑金)	Eurex Clearing		派生 株式関連取引	0	579,410	0	579,410	2	28,970,522			0	0%	0	0	100		1	1	EURODEFF	0	0.00	28,970,522	1.00	163.24	0	0	0	28,970,522	0	Societe Generale International Limited	
先物	EUR	09709H1.2406.700	DAX MIN 2406			外国株・外国債券・海外商品株式又は海外商品債券	15,324,971	15,324,971	15,324,971	100	15,324,971	2024/03/11	2024/06/21	DF	0	0%	0	230136996	0	100		1	1		1	17,961.00	0	18,776.00	163.24	0	0	0	665,203	0	
先物	EUR	09709H1.2406.700	DAX MIN 2406			外国株・外国債券・海外商品株式又は海外商品債券	30,649,942	30,649,942	30,649,942	100	30,649,942	2024/03/11	2024/06/21	DF	0	0%	0	230136996	0	100		1	1		2	18,048.00	0	18,776.00	163.24	0	0	0	1,188,387	0	
先物	DE	09709H1.2406.700	DAX MIN 2406	Eurex Clearing		派生 株式関連取引	15,324,971	15,324,971	15,324,971	100	1,384,701	2024/03/11	2024/06/21	DF	0	6%	0	230136996	0	665,203	100	1	1	EURODEFF	1	17,961.00	0	18,776.00	163.24	0	0	0	665,203	919,498	Societe Generale International Limited
先物	DE	09709H1.2406.700	DAX MIN 2406	Eurex Clearing		派生 株式関連取引	30,649,942	30,649,942	30,649,942	100	3,027,383	2024/03/11	2024/06/21	DF	0	6%	0	230136996	0	1,188,387	100	1	1	EURODEFF	2	18,048.00	0	18,776.00	163.24	0	0	0	1,188,387	1,838,997	Societe Generale International Limited
為替予約	JP	5009720240507		株式会社 三菱UFJ銀行		派生 外為関連取引 先物外為為替取引	1,488,092,632	4,404,278	1,488,092,632	4,404,278	20	22,021,389	2024/03/29	2024/05/07		0	1%	0	106849318	0	100		1	1	5	162.49	-9,035,000	162.49	0	0	0	-2,491	14,680,926	株式会社 三菱UFJ銀行	