

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 ドイツ国債7-10年 (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	596,000
基準価額	509,779 (円)
純資産額	3,038,280,464 (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	リカ上位 (%)	リカ上位の加重平均 (%)	信用リカ削減効果前			信用リカ削減効果後		
				資産の額 (時価金額)	信用リカ77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77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	外国の中央政府及び中央銀行向け	0	0.00%	2,995,916,170	0	0.00%	2,995,916,170	0	0.00%
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	外国の中央政府等以外の公共部門向け	20							
6-2		50							
6-3		100							
6-4		150							
7-1	国際開発銀行向け	0							
7-2		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	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	20	20.00%	999,380,135	199,876,027	6.58%	999,380,135	199,876,027	6.58%
11-2		50							
11-3		100							
11-4		150							
11-5		250							
12-1	法人等向け	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	不動産取得等事業向け	100							
15-2		150							
16-1	三月以上延滞等	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	出資等	100							
20-2		250							
21	上記以外	100							
22-1	証券化商品及び不良債権証券化商品 (オリジネーター以外)	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	再証券化商品 (オリジネーター以外)	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	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							
52-2		2							
52-3		4							
52-4		20							
資産の額計				3,995,296,305			3,995,296,305		
リスクアセット計					199,876,027	6.58%		199,876,027	6.58%

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	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「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、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いますが、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						
11	派生商品取引	—	3,016,705,908	13,770,936	0.45%	3,016,705,908	13,770,936	0.45%
11-1	外国為替関連取引	—	3,016,705,908	13,160,916	0.43%	3,016,705,908	13,160,916	0.43%
11-2	金利関連取引	—	0	610,020	0.02%	0	610,020	0.02%
11-3	金関連取引	—	—	—	—	—	—	—
11-4	株式関連取引	—	—	—	—	—	—	—
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	証券化エクスポートに係る適格流動性補完及び適格なサービス・キャシュ・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ト	100						
リスクアセット計(中央清算機関)				610,020	0.02%		610,020	0.02%
リスクアセット計				13,770,936	0.45%		13,770,936	0.45%

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	10,402,370
オフ・バランス・オフ・バランス リスクアセット計	213,646,963
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)	7.03%

※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	3,016,705,908			3,016,705,908		65,804,583	13,160,916	0.43%
(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	3,016,705,908			3,016,705,908		65,804,583	13,160,916	0.43%
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					0	30,501,028	610,020	0.02%
(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					0	30,501,028	610,020	0.02%
3	金関連取引								
4	株式関連取引								
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						96,305,611	13,770,936	0.45%

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	残高(%)	想定元本額 (信用リク削減効果適用前)		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取得を含む経過措置を適用しない元本額を確保するクレジット・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・ブローに係る適格流動性補完及び適格なデリバティブ(0~100%)	上記以外のワレット・ブローの証券化ワレット(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%)										
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、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		2											
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)												
	残高及びリスクアセット計												

※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。

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 (統一コード名称・中央清算機関名称)	資産科目名称	信用付債流動資産		信用付債流動負債		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 チエ リタイ	ポジション 区分	再構築321	按分比率	レバレッジ 比率	身価相違 種別数	ポジション 別(22-1)	残高数量	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	統一コード名称
							想定元本	現在残高 %15778118	想定元本	現在残高 %12778118																									
勘定	EUR	BSP1211004	BSP1211004	未払金(一般公社債)		集計対象外(オフ)	0	0	0	0	0				0	0%	0	0	100	1	1		0	0.00	-888,487	1.00	163.24	0	0	0	0	-888,487	0		
勘定	JPY	BSP1142000	BSP1142000	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	1,016,356,500	1.00	0	0	0	0	0	1,016,356,500	0			
勘定	JPY	BSP1142000	BSP1142000	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	10,302,490	1.00	1	0	0	0	0	10,302,490	0			
勘定	JPY	BSP1211009	BSP1211009	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	-10,314,455	1.00	1	0	0	0	0	-10,314,455	0			
勘定	JPY	BSP1222000	BSP1222000	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	-10,314,455	1.00	1	0	0	0	0	-10,314,455	0			
勘定	JPY	BSP1223000	BSP1223000	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	-117,417	1.00	1	0	0	0	0	-117,417	0			
勘定	JPY	BSP1224000	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	-399,189	1.00	1	0	0	0	0	-399,189	0			
勘定	JPY	BSP1243003	BSP1243003	その他未払費用(証券)		集計対象外(オフ)	0	0	0	0	0				0	0%	0	100	1	1		0	0.00	-14,041	1.00	1	0	0	0	0	-14,041	0			
勘定	JPY	BSP1243004	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	100	1	1		0	0.00	-548,910	1.00	1	0	0	0	0	-548,910	0			
勘定	JPY	BSP1243006	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	-381,665	1.00	1	0	0	0	0	-381,665	0			
勘定	JPY	BSP1251000	BSP1251000	未払替		集計対象外(オフ)	0	0	0	0	0				0	0%	0	100	1	1		0	0.00	-3,016,366,888	1.00	1	0	0	0	0	-3,016,366,888	0			
勘定	JPY	BSP1251000	BSP1251000	未払替		集計対象外(オフ)	0	0	0	0	0				0	0%	0	100	1	1		0	0.00	-10,302,490	1.00	1	0	0	0	0	-10,302,490	0			
勘定	EUR	BSP1152001	BSP1152001	貸入委託証券(現金)	LYON CLAIRFIRE	派生 未払国債取引	0	610,021	0	610,021	2	30,501,028	2024/03/28	2024/04/04	0	0%	0	100	1	1		1	0.00	30,501,028	1.00	163.44	0	0	0	0	30,501,028	0	Societe Generale International Limited		
勘定	JP	5009120240404	5009120240404	貸入委託証券(現金)	株式会社 三菱UFJ銀行	派生 未払国債取引	0	0	0	0	0	22,790,955	2024/03/27	2024/05/08	0	1%	0	100	1	1		1	801KJPJ2	-63,000	163.35	0	163.12	163.1238	0	0	0	22,790,955	0	株式会社 三菱UFJ銀行	
勘定	JP	5009120240508	5009120240508	貸入委託証券(現金)	株式会社 三菱UFJ銀行	派生 未払国債取引	986,669,032	4,558,191	986,669,032	4,558,191	20	5,327,280	2024/03/27	2024/05/08	0	1%	0	100	1	1		1	801KJPJ2	-6,040,000	163.36	0	162.47	162.4738	0	0	0	5,327,280	0	株式会社 三菱UFJ銀行	
勘定	JP	5009120240508	5009120240508	貸入委託証券(現金)	株式会社 三菱UFJ銀行	派生 未払国債取引	2,030,036,876	8,602,726	2,030,036,876	8,602,726	20	8,662,726	2024/03/28	2024/05/08	0	1%	0	100	1	1		1	801KJPJ2	-12,441,000	163.15	0	162.47	162.4738	0	0	0	8,662,726	0	株式会社 三菱UFJ銀行	