

**投資信託資産構成内容**  
(バーゼルⅢ：標準的手法対応)

TOPIXペア2倍上場投信		元本通貨 為替レート	JPY 1.00
設定日	2014年05月28日		
基準日	2023年03月31日		
総口数	4,760,000		
基準価額	819 (円)		
純資産額	3,897,439,473 (円)		

## ◆オンバランス項目に関する構成内容 (第1表)

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 外国の中央政府及び中央銀行向け		0							
3-2 外国の中央政府等以外の公共部門向け		20							
3-3 國際決済銀行等向け		100							
3-4 國際開発銀行等向け		150							
4 國際決済銀行等向け		0							
5 我が国の地方公共団体向け		0							
6-1 外国の地方公共団体向け		20							
6-2 國際開発銀行等向け		50							
6-3 國際開発銀行等向け		100							
6-4 國際開発銀行等向け		150							
7-1 國際開発銀行等向け		0							
7-2 國際開発銀行等向け		20							
7-3 國際開発銀行等向け		50							
7-4 國際開発銀行等向け		100							
7-5 國際開発銀行等向け		150							
8-1 我が国の政府関係機関向け		10							
8-2 國際開発銀行等向け		20							
9-1 地方公共団体金融機関向け		10							
9-2 地方公共団体金融機関向け		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		3,681,403,654	736,280,730	18.89%	3,681,403,654	736,280,730	18.89%
11-2 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け		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 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け		150							
11-5 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け		250							
12-1 法人等向け		20							
12-2 法人等向け		50							
12-3 法人等向け		100							
12-4 法人等向け		150							
12-5 法人等向け		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 不動産取得等事業向け		150							
16-1 三月以上延滞等		50							
16-2 三月以上延滞等		100							
16-3 三月以上延滞等		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 出資等		250							
21 上記以外		100							
22-1 証券化商品 (リゾーネー以外)		0~50未満							
22-2 証券化商品 (リゾーネー以外)		50~100未満							
22-3 証券化商品 (リゾーネー以外)		100~250未満							
22-4 証券化商品 (リゾーネー以外)		250~350未満							
22-5 証券化商品 (リゾーネー以外)		350~1,250未満							
23-1 再証券化商品 (リゾーネー以外)		0~100未満							
23-2 再証券化商品 (リゾーネー以外)		100~225未満							
23-3 再証券化商品 (リゾーネー以外)		225~450未満							
23-4 再証券化商品 (リゾーネー以外)		450~1,250未満							
23-5 再証券化商品 (リゾーネー以外)		1,250以上							
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 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		150~350未満							
24-3 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		350~650未満							
24-4 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		650~1,250未満							
24-5 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		1,250以上							
52-1 中央清算機関		0							
52-2 中央清算機関		4							
52-3 中央清算機関		20							
資産の額計		3,681,403,654							
リスクアセット計		736,280,730							
		18.89%							
金融機関出資計 (時価金額)	対象普通株式等								
	適格旧非累積の永久優先株								
	適格旧資本調達手段								
	その他								

項目	資産項目	掛け目（%）	元本通貨：JPY			為替レート：1		
			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	短期の貿易関連偶発債務	20						
4	特定の取引に係る偶発債務 (うち経過措置を適用する元本補てん信託契約)	50						
4-2		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偶発債務	100						
7-2	(うち信入金の保証)	100						
7-3	(うち有価証券の保証)	100						
7-4	(うち手形引受け)	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	(うちレンタリハイクのアカウント提供)	100						
8	有価証券の貯蔵、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	0	5,228,600	0.13%	0	5,228,600	0.13%
11	派生商品取引	—	7,793,615,000	10,288,037	0.26%	7,793,615,000	10,288,037	0.26%
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	—	793,615,000	10,288,037	0.26%	793,615,000	10,288,037	0.26%
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・パートナー・リスク)	—						
一括清算オペレーション契約による与信相当額削減効果（△）			—					
12	長期決済期間取引	—						
13	未決済取引	—						
14	証券化カブオ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・バランスの証券化カブオージャー	100						
	リスクアセット計（中央清算機関）			15,516,637	0.40%		15,516,637	0.40%
	リスクアセット計			15,516,637	0.40%		15,516,637	0.40%

有価証券等の決済に係る未収金 1,942,850

オーバーランス・オーバーランス リスクアセット計 751,797,367

オーバーランス・オーバーランス リスクアセット比率（%/対純資産額） 19.29%

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)	先物外國為替取引								
(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	7,793,615,000			7,793,615,000		514,401,875	10,288,037	0.26%
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・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						514,401,875	10,288,037	0.26%

オプション・ポジション

		想定元本		評価金額
		売り	買い	
コール	売り			
	買い			
プット	買い			
	売り			

