

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

TOPIXベア2倍上場投信

2014 年 05 月 28 日
2023 年 03 月 31 日
4,760,000
819 (円)
3,897,439.473 (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)	信用リスクウェイトの額	リスクアセット比率 (%/対純資産額)	資産の額 (時価金額)	信用リスクウェイトの額	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	外国の中央政府及び中央銀行向け	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	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%	3,681,403,654	736,280,730	18.89%	3,681,403,654	736,280,730	18.89%
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		50							
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(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		7							
52-4		20							
資産の額計				3,681,403,654			3,681,403,654		
リスクアセット計					736,280,730	18.89%		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		

◆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	短期の貿易関連偶発債務	20						
4	特定の取引に係る偶発債務	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	N I F又はR U F	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	(うち借入金金の保証)	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・デリバティブの反対方向提供)	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	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	—						
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 (△)			—					
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ービス・キャパシティ・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)				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

オフ・バランス・オフ・バランス リスクアセット計

751,797,367

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)

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)	為替先渡し取引 (FXA)								
(3)	先物外国為替取引								
(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)	金利先渡し取引 (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						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
コール	売り		
	買い		
プット	買い		
	売り		

項目	資産項目	想定元本額(信用リスク削減効果適用前)	リスクレイト(%)	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資産価値(含む経過措置を適用しない元本額で元金控除額、クレジット・デリバティブのポジションはプロポジション提供)	有価証券の貸付、現金若しくは本振証券による担保の提供又は有価証券の買戻条件付売却又は求償権付売却等(100%)	買戻条件付資産売却又は求償権付売却等(100%)	先物購入、先物預金、部分払込株式又は部分払込債券(100%)	証券化スプレッド・プリーミイに係る過剰流動性(0~100%)	上記以外の20%以下の証券化スプレッド・プリーミイ(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		50													
3-4		100													
3-5		150													
4	国際決済銀行等向け	0													
5		0													
6-1	我が国の地方公共団体向け	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	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		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	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		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													
	繰上及びリスクアセット計(除く中央清算機関)														
	繰上及びリスクアセット計(中央清算機関)														
	繰上及びリスクアセット計														