

投資信託資産構成内容

ファンドコード	614955	ファンド名称	上場インデックスファンドアジアリート	
当初設定日	2017年 6月 22日		基準価額	10,427 円
純資産総額	615,196,882 円		受益権口数	59,000 口

表記投資信託の資産構成内容は次の通りです。

オン・バランス取引等項目信用リスク・アセット残高内訳表

2017年9月29日現在

資産科目	リスクウェイト (%)	金額 (円)	リスクアセット (円)	純資産比率 (%)
1 現金 (除く差入担保・証拠金)		0	0	0.00
2 我が国の中央政府及び中央銀行		0	0	0.00
3 外国の中央政府及び中央銀行		0	0	0.00
4 国際決済銀行等		0	0	0.00
5 我が国の地方公共団体		0	0	0.00
6 外国の中央政府等以外の公共部門		0	0	0.00
7 国際開発銀行		0	0	0.00
8 我が国の政府関係機関		0	0	0.00
10 地方三公社		0	0	0.00
11 金融機関及び証券会社	20.00	11,159,667	2,231,933	0.36
12 上記を除く法人		0	0	0.00
13 中小企業等及び個人		0	0	0.00
14 抵当権付住宅ローン		0	0	0.00
15 不動産取得等事業		0	0	0.00
16 3カ月以上延滞債権等		0	0	0.00
17 取立未済手形		0	0	0.00
18 信用保証協会による保証付		0	0	0.00
19 地方公共団体金融機構		0	0	0.00
20 出資等	100.00	614,643,084	614,643,084	99.91
21 上記以外		0	0	0.00
22 証券化商品 (オリジネーター以外)		0	0	0.00
23 複数の資産を裏付とする資産のうち、個々の資産の把握が困難な部分の額		0	0	0.00
合計		625,802,751	616,875,017	100.27

金融機関等への出資に係る資産構成内容は次の通りです。

金融機関等出資計	普通株式	0	0.00
	優先株	0	0.00
	その他 (劣後債等)	0	0.00

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。現時点での弊社取扱において算出したものであり、将来にわたって保証されるものでもありません。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なく、当資料の情報を使用する際はご自身でリスクアセット分類を確認することを強くお奨めします。

※1 ダブルギアリング対象金融機関区分に関しては日本標準産業分類を基に分類しております。

※2 オフ・バランス取引等項目信用リスク・アセット残高内訳表のCVAリスク相当額については、簡便的リスク測定方式を用いて集計しております。

(別紙)

ファンドコード	614955	ファンド名	上場インデックスファンドアジアリート
---------	--------	-------	--------------------

オフ・バランス取引等項目信用リスク・アセット残高内訳表

2017年9月29日現在

項目番号	項目	リスクウエイト (%)	想定元本額 (円)	再構築コスト (円)	与信相当額 (円)	リスクアセット (円)	純資産比率 (%)
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		0	0	0.00
2	原契約期間が1年以下のコミットメント		0		0	0	0.00
3	短期の貿易関連偶発債務		0		0	0	0.00
4	特定の取引に係る偶発債務		0		0	0	0.00
5	(うち経過措置を適用する元本補てん信託契約)		0		0	0	0.00
6	N I F又はR U F		0		0	0	0.00
7	原契約期間が1年超のコミットメント		0		0	0	0.00
8	信用供与に直接代替する偶発債務						
9	(うち借入金の保証)		0		0	0	0.00
10	(うち有価証券の保証)		0		0	0	0.00
11	(うち手形引受)		0		0	0	0.00
12	(うち経過措置を適用する元本補てん信託契約)		0		0	0	0.00
13	(うちクレジット・デリバティブのプロテクション提供)		0		0	0	0.00
14	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、売戻条件付購入		0		0	0	0.00
15	買戻条件付又は求償権付の資産売却		0		0	0	0.00
16	先物資産購入、先渡預金、部分払込株式の購入又は部分払込債券の購入		0		0	0	0.00
17	派生商品取引						
18	(うち外国為替関連取引)		0	0	0	0	0.00
19	(うち金利関連取引)		0	0	0	0	0.00
20	(うち金関連取引)		0	0	0	0	0.00
21	(うち株式関連取引)		0	0	0	0	0.00
22	(うち貴金属(金を除く)関連取引)		0	0	0	0	0.00
23	(うちその他コモディティ取引)		0	0	0	0	0.00
24	クレジット・デリバティブ取引		0		0	0	0.00
25	長期決済期間取引		0		0	0	0.00
26	未決済取引		0		0	0	0.00
27	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・キャッシュ・アドバンス		0		0	0	0.00
28	上記以外のオフ・バランスの証券化エクスポージャー		0		0	0	0.00
29	中央清算機関向けのエクスポージャー		0	0	0	0	0.00
30	CVAリスク相当額を8%で除して得た額					0	0.00
	合計(中央清算機関を除く)		0	0	0		
	合計(中央清算機関を含む)		0	0	0	0	0.00

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エ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。現時点での弊社取扱において算出したものであり、将来にわたって保証されるものでもありません。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なく、当資料の情報を使用する際はご自身でリスクアセット分類を確認することを強くお奨めします。

※1 ダブルギアリング対象金融機関区分に関しては日本標準産業分類を基に分類しております。

※2 オフ・バランス取引等項目信用リスク・アセット残高内訳表のCVAリスク相当額については、簡便的リスク測定方式を用いて集計しております。