

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

楽天ETF－日経ダブルインバース指数連動型

設定日	2015年07月14日
基準日	2024年09月30日
総口数	54,531,900
基準価額	52,302 (円)
純資産額	28,521,142,909 (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		12,192,646,084	2,438,529,216	8.55%	12,192,646,084	2,438,529,216	8.55%
11-2		50	20.00%						
11-3		100							
11-4		150							
11-5		250							
12-1	法人等向け	20		4,997,864,277	999,572,855	3.50%	4,997,864,277	999,572,855	3.50%
12-2		50	20.00%						
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株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	10							
19		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(オシネット以外)	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(オシネット以外)	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				17,190,510,361			17,190,510,361		
リスクアセット計					3,438,102,071	12.05%		3,438,102,071	12.05%

金融機関出資計 (時価金額)	対象普通株式等	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	

当資料は、上記ファンドで保有する資産についてお客様が自己資本比率を算出する上で参考にして頂く事を目的として信頼のできる公開情報に基づき当社の計理関連システムから作成したものです。その確実性あるいは完結性を表明するものではありません。資産科目の分類やリスク・ウェイトの付与等については当社の独自の判断によることもありますので、あらかじめご承知くださいますようお願い致します。

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	5,099,847,000	1,019,969,400	3.58%	5,099,847,000	0	0.00%
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	—	54,723,900,000	225,744,778	0.79%	54,723,900,000	225,744,778	0.79%
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	—	54,723,900,000	225,744,778	0.79%	54,723,900,000	225,744,778	0.79%
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ビサーキャプション 上記以外のオフ・バランスの証券化エクスポージャー	0~100						
15	リスクアセット計（中央清算機関）	100		225,744,778	0.79%		225,744,778	0.79%
	リスクアセット計			1,245,714,178	4.37%		225,744,778	0.79%

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

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）

当資料は、上記ファンドで保有する資産についてお客様が自己資本比率を算出する上で参考にして頂く事を目的として信頼のできる公開情報に基づき当社の計理関連システムから作成したものです。その確実性あるいは完結性を表明するものではありません。資産科目の分類やリスク・ウェイトの付与等については当社の独自の判断によることもありますので、あらかじめご承知くださいますようお願い致します。

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								
(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	54,723,900,000			54,723,900,000	0	11,287,238,930	225,744,778	0.79%
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						11,287,238,930	225,744,778	0.79%

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		

当資料は、上記ファンドで保有する資産についてお客様が自己資本比率を算出する上で参考にして頂く事を目的として信頼のできる公開情報に基づき当社の計理関連システムから作成したものです。その確実性あるいは完結性を表明するものではありません。資産科目の分類やリスク・ウェイトの付与等については当社の独自の判断によることもありますので、あらかじめご承知くださいますようお願い致します。

項目	資産項目	想定元本額 (信用引当削減効果適用前)	引当率 (%)	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経過措置を適用しない完結してん債権契約、クレジット・デリバティブのポジション提供 (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又は未償付資産買戻 (100%)	買戻条件付資産売却又は未償付資産買戻 (100%)	先物購入、先物売却、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・デリバティブ (0~100%)	上記以外のワレット・ブローカー・デリバティブ (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									5,099,847,000				
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	不動産取得等事業向け	100													
15-2		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	証券化商品及び不良債権証券化商品 (リソネット以外)	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	再証券化商品 (リソネット以外)	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、	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	中央清算機関	4													
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)										5,099,847,000				
	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										5,099,847,000				

当資料は、上記ファンドで保有する資産についてお客様が自己資本比率を算出する上で参考にして頂く事を目的として信頼のできる公開情報に基づき当社の計理関連システムから作成したものです。その確実性あるいは完結性を表明するものではありません。資産科目の分類やリスク・ウェイトの付与等については当社の独自の判断によることもありますので、あらかじめご承知くださいますようお願い致します。

ファンド名称： 楽天ETF－日経ダブルインバース指数連動型  
 基準年月日： 2024/9/30 オン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	ISINコード	銘柄名	統一プロダクト名称	信用リスク削減効果前				信用リスク削減効果後				評価金額(円)	未収利息(円)	前払金残(円)	実効マチュリティ	金融機関区分	出資区分	他の金融機関等出資区分	按分比率	レバレッジ比率	STC要件	優先劣後区分	アタッチメントポイント	デタッチメントポイント	統一プロダクトBICコード	
							資産科目名称	時価合計	リスクウェイト	個別銘柄リスクウェイト	資産科目名称	時価合計	リスクウェイト	個別銘柄リスクウェイト															
短期・その他		JPY	6504FB240926000	JP90A02L04F9	アコム		法人等向け	999,516,138	20	199,903,228	法人等向け	999,516,138	20	199,903,228	999,482,186	33,852	0	0.2		9			1						
短期・その他		JPY	6500CB240117000	JP90A18200C5	エッセンシャルジョウモ		金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	999,339,699	20	199,387,940	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	999,339,699	20	199,387,940	999,501,618	438,680	0	0.2		9			1						
短期・その他		JPY	65019B240611000	JP90A1820197	SMT L&F		法人等向け	999,268,287	20	199,853,657	法人等向け	999,268,287	20	199,853,657	999,150,858	117,429	0	0.2		9			1						
短期・その他		JPY	6512KB240809000	JP90A20212K4	NTTコム		法人等向け	999,654,970	20	199,930,994	法人等向け	999,654,970	20	199,930,994	999,490,670	164,300	0	0.2		9			1						
短期・その他		JPY	658FDB240718000	JP90A00MBFD9	ミツイストモビル		法人等向け	999,901,368	20	199,980,274	法人等向け	999,901,368	20	199,980,274	999,496,144	405,224	0	0.2		9			1						
短期・その他		JPY	6581VB240930000	JP90A001B1V7	ミスホリース		法人等向け	999,523,514	20	199,804,703	法人等向け	999,523,514	20	199,804,703	999,523,514	0	0	0.2		9			1						
短期・その他	JP	JPY	82000		コールローン(オーバーナイト)	セントラル短資	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	11,192,706,385	20	2,238,541,271	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	11,192,706,385	20	2,238,541,271	11,192,672,655	33,731	0	0											CTRLJPJT

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 (統一プロダクト名・中央清算機関名称)	資産科目名称	信用リスク削減効果前		信用リスク削減効果後		リスクカテゴリー	個別銘柄与信 相当額	個別建玉 約定日	取引終了日	原資産 銘柄コード	原資産銘柄 価格	アドオン掛 目	実効マチュ リティ	ポジション 区分	再構築コスト	投分比率	レバレッ ジ比率	与信相 関係数	カウンター パーティ BICコード
							想定元本	個別銘柄 リスク残額	想定元本	個別銘柄 リスク残額														
勘定		JPY	BSPL143000	先物取引未収入金		集計対象外(オフ)	0	0	0	0														
勘定		JPY	BSPL211021	未払金(先物取引)		集計対象外(オフ)	0	0	0	0														
勘定		JPY	BSPL223000	未払委託者報酬		集計対象外(オフ)	0	0	0	0														
勘定		JPY	BSPL243003	未払委託者報酬		集計対象外(オフ)	0	0	0	0														
勘定		JPY	BSPL243003	その他未払費用(監査)		集計対象外(オフ)	0	0	0	0														
勘定		JPY	BSPL243004	その他未払費用(印刷)		集計対象外(オフ)	0	0	0	0														
勘定		JPY	BSPL243005	その他未払費用(その他1)		集計対象外(オフ)	0	0	0	0														
勘定		JPY	BSPL243006	その他未払費用(その他2)		集計対象外(オフ)	0	0	0	0														
勘定		JPY	BSPL252000	先物取引未勘定		集計対象外(オフ)	0	0	0	0														
証拠金	JP	JPY	I2400061000000000	委託証拠金	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	0	152,027,698	0	152,027,698	2													
信用取引・現先	JP	JPY	B 0074.1224	東京短資	東京短資	5,099,847,000	1,019,969,400	5,099,847,000	0	0														
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	23,035,650,000	27,642,780	23,035,650,000	27,642,780	2													
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	1,138,500,000	1,365,200	1,138,500,000	1,365,200	2													
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	1,442,100,000	1,730,520	1,442,100,000	1,730,520	2													
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	1,973,400,000	2,368,080	1,973,400,000	2,368,080	2													
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	1,366,200,000	1,639,440	1,366,200,000	1,639,440	2													
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	151,800,000	182,160	151,800,000	182,160	2													
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	37,950,000	45,540	37,950,000	45,540	2													
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	1,252,350,000	1,502,820	1,252,350,000	1,502,820	2													
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	1,821,600,000	2,189,920	1,821,600,000	2,189,920	2													
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	37,950,000	45,540	37,950,000	45,540	2													
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	75,900,000	91,080	75,900,000	91,080	2													
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	721,050,000	865,260	721,050,000	865,260	2													
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	379,500,000	455,400	379,500,000	455,400	2													
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	75,900,000	91,080	75,900,000	91,080	2													
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	721,050,000	865,260	721,050,000	865,260	2													
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	759,000,000	910,800	759,000,000	910,800	2													
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	75,900,000	118,862	75,900,000	118,862	2													
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	341,550,000	537,581	341,550,000	537,581	2													
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	3,946,800,000	6,212,045	3,946,800,000	6,212,045	2													
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	189,750,000	414,156	189,750,000	414,156	2													
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	1,935,450,000	4,260,091	1,935,450,000	4,260,091	2													
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	2,049,300,000	4,510,685	2,049,300,000	4,510,685	2													
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	2,239,050,000	4,928,341	2,239,050,000	4,928,341	2													
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	7,210,500,000	8,652,600	7,210,500,000	8,652,600	2													
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	607,200,000	728,640	607,200,000	728,640	2													
先物	JP	JPY	000040.2412	日経平均株価指数先物	日本証券クリアリング機構	派生 株式関連取引	1,138,500,000	1,366,200	1,138,500,000	1,366,200	2													