

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 | 2020年09月30日 |
| 総口数 | 9,626,100 |
| 基準価額 | 282,645 (円) |
| 純資産額 | 27,207,678,259 (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 | | 10,972,217,177 | 2,194,443,435 | 8.07% | 10,972,217,177 | 2,194,443,435 | 8.07% |
| 11-2 | | 50 | | | | | | | |
| 11-3 | | 100 | 20.00% | | | | | | |
| 11-4 | | 150 | | | | | | | |
| 11-5 | | 250 | | | | | | | |
| 12-1 | 法人等向け | 20 | | 3,000,000,000 | 600,000,000 | 2.21% | 3,000,000,000 | 600,000,000 | 2.21% |
| 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(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 | | | | 13,972,217,177 | | | 13,972,217,177 | | |
| リスクアセット計 | | | | | 2,794,443,435 | 10.27% | | 2,794,443,435 | 10.27% |

| | | |
|----------------|--------------|------------|
| 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・デリバティブのフロンティア提供) | 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 | 9,800,294,000 | 1,960,058,800 | 7.20% | 9,800,294,000 | 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 | — | 54,310,980,000 | 141,155,327 | 0.52% | 54,310,980,000 | 141,155,327 | 0.52% |
| 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 | — | 54,310,980,000 | 141,155,327 | 0.52% | 54,310,980,000 | 141,155,327 | 0.52% |
| 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(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 | | 141,155,327 | 0.52% | | 141,155,327 | 0.52% |
| | リスクアセット計 | | | 2,101,214,127 | 7.72% | | 141,155,327 | 0.52% |

| | |
|--------------------------|---------------|
| 有価証券等の決済に係る未収金 | |
| オフ・バランス リスクアセット計 | 2,935,598,762 |
| オフ・バランス リスクアセット比率(対純資産額) | 10.79% |

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 | 54,310,980,000 | | | 54,310,980,000 | 0 | 7,057,766,360 | 141,155,327 | 0.52% |
| 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 | | | | | | 7,057,766,360 | 141,155,327 | 0.52% |

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増進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売却等 (100%) | 買戻条件付資産売却又は未償付資産売却等 (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 | 国際開発銀行向け | 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 | 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け | 100 | | | | | | | | | 9,800,294,000 | | | | |
| 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 | | 50~100未満 | | | | | | | | | | | | | |
| 22-3 | 証券化商品(ワレット以外) | 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(ワレット以外) | 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 | | 4 | | | | | | | | | | | | | |
| 52-3 | | 4 | | | | | | | | | | | | | |
| 52-4 | 中央清算機関 | 20 | | | | | | | | | | | | | |
| | 残高及びリスクアセット計(除く中央清算機関) | | | | | | | | | | 9,800,294,000 | | | | |
| | 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 | | | | | | | | | | 9,800,294,000 | | | | |

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。資産科目の種類やリスク・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: 楽天ETF-日経ダブルインバース指数連動型
 基準年月日: 2020/9/30
 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 | 統一ブローカー名称 | 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 | 統一ブローカーBICコード | | |
|--------|------|-------|-----------------|--------------|------------|-----------|---------------------|----------------|---------|---------------|---------------------|----------------|---------|---------------|----------------|---------|---------|----------|--------|------|-------------|------|---------|-------|--------|-------------|-------------|---------------|--|----------|
| | | | | | | | 資産科目名称 | 時価合計 | リスクウェイト | 個別銘柄リスクオフ額 | 資産科目名称 | 時価合計 | リスクウェイト | 個別銘柄リスクオフ額 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 短期・その他 | | JPY | 62000 | | コールローン | 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 | 10,972,217,177 | 20 | 2,194,443,435 | 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け | 10,972,217,177 | 20 | 2,194,443,435 | 10,972,248,741 | -31,564 | 0 | 0 | | | | | | | | | | | | CTRLJPJT |
| 短期・その他 | | JPY | 6500BB200924000 | JP90A07300B3 | ノバルティス | | 法人等向け | 1,000,000,000 | 20 | 200,000,000 | 法人等向け | 1,000,000,000 | 20 | 200,000,000 | 1,000,000,000 | 0 | 0 | 0 | 2 | | 9 | | | | | | | | | |
| 短期・その他 | | JPY | 650CVB200910000 | JP90A16Z0CV0 | SMT L&F | | 法人等向け | 1,000,000,000 | 20 | 200,000,000 | 法人等向け | 1,000,000,000 | 20 | 200,000,000 | 1,000,000,000 | 0 | 0 | 0 | 2 | | 9 | | | | | | | | | |
| 短期・その他 | | JPY | 65A7XB200930000 | JP90A00MA7X7 | ミツイスミトモF&L | | 法人等向け | 1,000,000,000 | 20 | 200,000,000 | 法人等向け | 1,000,000,000 | 20 | 200,000,000 | 1,000,000,000 | 0 | 0 | 0 | 2 | | 9 | | | | | | | | | |

ファンド名: 楽天ETF-日経ダブルインバース指数連動型
 基準年月日 2020/9/30 オフ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 | 銘柄名 | カンパニー名称 (統一ローカール名称・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 | | リスクウェイト | 個別銘柄と信用 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 リリティ | ポジション区 分 | 再構築コスト | 按分比率 | レバレッジ 比率 | 与信相当 額係数 | カンパニー BICコード |
|---------|------|-------|--------------------|----------------|---------------------------------|---------------|----------------|------------------|----------------|------------------|---------------|----------------|-------------|------------|--------------|-------------|------------|---------------|-------------|---------------|------|-------------|-------------|-----------------|
| | | | | | | | 想定元本 | 個別銘柄 リスクアセット額 | 想定元本 | 個別銘柄 リスクアセット額 | | | | | | | | | | | | | | |
| 勘定 | | JPY | BSPL143000 | 先物取引未収入金 | | 集計対象外(オフ) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0% | 0 | L | 0 | | 1 | 1 | | |
| 勘定 | | JPY | BSPL211021 | 未払金(先物取引) | | 集計対象外(オフ) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0% | 0 | L | 0 | | 1 | 1 | | |
| 勘定 | | JPY | BSPL223000 | 未払委託者報酬 | | 集計対象外(オフ) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0% | 0 | L | 0 | | 1 | 1 | | |
| 勘定 | | JPY | BSPL224000 | 未払委託者報酬 | | 集計対象外(オフ) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0% | 0 | L | 0 | | 1 | 1 | | |
| 勘定 | | JPY | BSPL243002 | 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 | L | 0 | | 1 | 1 | | |
| 勘定 | | JPY | BSPL243003 | その他未払費用(監査) | | 集計対象外(オフ) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0% | 0 | L | 0 | | 1 | 1 | | |
| 勘定 | | JPY | BSPL243004 | その他未払費用(印刷) | | 集計対象外(オフ) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0% | 0 | L | 0 | | 1 | 1 | | |
| 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 | 0 | | | | 0 | 0% | 0 | L | 0 | | 1 | 1 | | |
| 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 | 0 | | | | 0 | 0% | 0 | L | 0 | | 1 | 1 | | |
| 勘定 | | JPY | BSPL252000 | 先物取引売勘定 | | 集計対象外(オフ) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0% | 0 | L | 0 | | 1 | 1 | | |
| 証拠金 | | JPY | 124000061000000000 | 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 | 75,295,868 | 0 | 75,295,868 | 2 | 3,764,793,400 | | | | 0 | 0% | 0 | L | 3,764,793,400 | 1 | 1 | JSCCJPJ1 | |
| 信用取引・現先 | | JPY | B.0074.921 | 第9-2-1 回国庫短期証券 | 東京短資株式会社 | 9,800,294,000 | 1,960,058,800 | 9,800,294,000 | 1,960,058,800 | 0 | 9,800,294,000 | 2020/09/30 | 2020/10/12 | B.0074.921 | 0 | 0% | 0 | L | 0 | | 1 | 1 | TKTSJPJT | |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 278,280,000 | 333,936 | 278,280,000 | 333,936 | 2 | 16,696,800 | 2020/09/08 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 0 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 41,695,620,000 | 50,034,744 | 41,695,620,000 | 50,034,744 | 2 | 2,501,737,200 | 2020/09/08 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 0 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 278,280,000 | 333,936 | 278,280,000 | 333,936 | 2 | 16,696,800 | 2020/09/08 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 0 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 69,570,000 | 83,484 | 69,570,000 | 83,484 | 2 | 4,174,200 | 2020/09/10 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 0 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 92,760,000 | 112,077 | 92,760,000 | 112,077 | 2 | 5,603,840 | 2020/09/11 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 38,240 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 440,610,000 | 532,365 | 440,610,000 | 532,365 | 2 | 26,618,240 | 2020/09/11 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 181,640 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 23,190,000 | 32,419 | 23,190,000 | 32,419 | 2 | 1,620,960 | 2020/09/14 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 229,560 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 208,710,000 | 291,773 | 208,710,000 | 291,773 | 2 | 14,588,640 | 2020/09/14 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 2,066,040 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 23,190,000 | 30,419 | 23,190,000 | 30,419 | 2 | 1,520,960 | 2020/09/15 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 129,560 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 115,950,000 | 152,096 | 115,950,000 | 152,096 | 2 | 7,604,800 | 2020/09/15 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 647,800 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 139,140,000 | 178,915 | 139,140,000 | 178,915 | 2 | 8,945,760 | 2020/09/16 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 597,360 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 2,156,670,000 | 2,791,786 | 2,156,670,000 | 2,791,786 | 2 | 139,589,280 | 2020/09/16 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 10,189,080 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 347,850,000 | 417,420 | 347,850,000 | 417,420 | 2 | 20,871,000 | 2020/09/17 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 0 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 208,710,000 | 250,452 | 208,710,000 | 250,452 | 2 | 12,522,600 | 2020/09/17 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 0 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 1,901,580,000 | 2,330,374 | 1,901,580,000 | 2,330,374 | 2 | 116,518,720 | 2020/09/18 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 2,423,920 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 23,190,000 | 27,828 | 23,190,000 | 27,828 | 2 | 1,391,400 | 2020/09/23 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 0 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 324,660,000 | 389,592 | 324,660,000 | 389,592 | 2 | 19,479,600 | 2020/09/24 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 0 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 1,507,350,000 | 1,808,820 | 1,507,350,000 | 1,808,820 | 2 | 90,441,000 | 2020/09/24 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 0 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 278,280,000 | 333,936 | 278,280,000 | 333,936 | 2 | 16,696,800 | 2020/09/25 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 0 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 69,570,000 | 88,858 | 69,570,000 | 88,858 | 2 | 4,442,880 | 2020/09/28 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 268,680 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 324,660,000 | 417,469 | 324,660,000 | 417,469 | 2 | 20,873,440 | 2020/09/28 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 1,393,840 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 324,660,000 | 481,869 | 324,660,000 | 481,869 | 2 | 24,093,440 | 2020/09/29 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 4,613,840 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 347,850,000 | 516,288 | 347,850,000 | 516,288 | 2 | 25,814,400 | 2020/09/29 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 4,943,400 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 463,800,000 | 688,384 | 463,800,000 | 688,384 | 2 | 34,419,200 | 2020/09/29 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 6,591,200 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 2,226,240,000 | 2,671,488 | 2,226,240,000 | 2,671,488 | 2 | 133,574,400 | 2020/09/30 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 0 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 69,570,000 | 83,484 | 69,570,000 | 83,484 | 2 | 4,174,200 | 2020/09/30 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 0 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 139,140,000 | 166,968 | 139,140,000 | 166,968 | 2 | 8,348,400 | 2020/09/30 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 0 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |
| 先物 | | JPY | 000040.2012 | 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 | 231,900,000 | 278,280 | 231,900,000 | 278,280 | 2 | 13,914,000 | 2020/09/30 | 2020/12/11 | NK225 | 0 | 6% | 0.197260274 | S | 0 | | 1 | 1 | JSCCJPJ1 |