

2024年9月期 中間決算短信 (2023年9月6日～2024年3月5日)

2024年4月12日

上場取引所 東証

ファンド名 政策保有解消推進ETF
 コード番号 2081
 連動対象指標 なし
 主要投資資産 株式
 売買単位 1口
 管理会社 シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社 URL <http://www.simplexasset.com/>
 代表者名 代表取締役社長 水嶋 浩雅
 問合せ先責任者 業務本部 山口 節一 TEL (03)6843-1413

半期報告書提出予定日 2024年6月5日

I ファンドの運用状況

1. 2024年3月中間期の運用状況 (2023年9月6日～2024年3月5日)

(1) 資産内訳

(百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計 (純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
2024年3月中間期	651	(87.3)	94	(12.7)	745	(100.0)

(2) 設定・解約実績

	前計算期間末 発行済口数 (①)	設定口数 (②)	解約口数 (③)	当中間計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
2024年3月中間期	-	1,200	570	630

(3) 基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	1口当たり基準価額 (③/当中間計算期間末発行済口数) × 1)
	百万円	百万円	百万円	円
2024年3月中間期	750	4	745	1,184

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更
② ①以外の変更

無
無

II 中間財務諸表

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

当中間計算期間末 (2024年3月5日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	49,017,237
株式	651,348,770
未収入金	49,746,041
未収配当金	472,100
流動資産合計	750,584,148
資産合計	750,584,148
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	158,150
未払委託者報酬	2,688,419
未払利息	6
その他未払費用	1,857,865
流動負債合計	4,704,440
負債合計	4,704,440
純資産の部	
元本等	
元本	630,000,000
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金(△)	115,879,708
元本等合計	745,879,708
純資産合計	745,879,708
負債純資産合計	750,584,148

（2）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	当中間計算期間 （自 2023年9月6日 至 2024年3月5日）
営業収益	
受取配当金	5,878,400
受取利息	196
有価証券売買等損益	105,670,410
その他収益	35
営業収益合計	111,549,041
営業費用	
支払利息	4,899
受託者報酬	158,150
委託者報酬	2,688,419
その他費用	1,857,865
営業費用合計	4,709,333
営業利益又は営業損失（△）	106,839,708
経常利益又は経常損失（△）	106,839,708
中間純利益又は中間純損失（△）	106,839,708
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	-
期首剰余金又は期首欠損金（△）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	9,040,000
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,580,000
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,460,000
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	115,879,708

（3）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の最終相場）で評価しております。 計算期間末日に当該金融商品取引所等の最終相場がない場合には、当該金融商品取引所等における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でない認められた場合は、当該金融商品取引所等における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融機関の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
-----------------	--

（中間貸借対照表に関する注記）

区分	当中間計算期間末 (2024年3月5日現在)	
1. 信託財産に係る期首元本額、期中追加設定元本額 及び期中解約元本額	期首元本額	200,000,000円
	期中追加設定元本額	1,000,000,000円
	期中解約元本額	570,000,000円
2. 受益権の総数		630,000口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	当中間計算期間末 (2024年3月5日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表計上額は中間期末の時価で計上しているためその差額はありませ
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 「中間注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

当中間計算期間末 (2024年3月5日現在)
1口当たりの純資産額 1,184円