

【表紙】

【提出書類】	四半期報告書
【根拠条文】	金融商品取引法第24条の4の7第2項
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2020年11月12日
【四半期会計期間】	第79期第2四半期（自 2020年7月1日 至 2020年9月30日）
【会社名】	株式会社SBI証券
【英訳名】	SBI SECURITIES Co., Ltd.
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 高村 正人
【本店の所在の場所】	東京都港区六本木一丁目6番1号
【電話番号】	03 - 5562 - 7210（代表）
【事務連絡者氏名】	専務取締役 齋藤 岳樹
【最寄りの連絡場所】	東京都港区六本木一丁目6番1号
【電話番号】	03 - 5562 - 7210（代表）
【事務連絡者氏名】	専務取締役 齋藤 岳樹
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【企業情報】

第1【企業の概況】

1【主要な経営指標等の推移】

回次	第78期 第2四半期 連結累計期間	第79期 第2四半期 連結累計期間	第78期
会計期間	自2019年4月1日 至2019年9月30日	自2020年4月1日 至2020年9月30日	自2019年4月1日 至2020年3月31日
営業収益 (百万円)	57,864	74,030	124,466
経常利益 (百万円)	18,291	27,316	42,622
親会社株主に帰属する四半期 (当期)純利益 (百万円)	11,734	18,988	27,976
四半期包括利益又は包括利益 (百万円)	11,911	19,008	28,286
純資産額 (百万円)	203,246	235,525	216,516
総資産額 (百万円)	3,392,962	3,891,738	3,357,613
1株当たり四半期(当期)純利 益金額 (円)	3,382.07	5,472.98	8,063.44
潜在株式調整後1株当たり四半 期(当期)純利益金額 (円)	-	-	-
自己資本比率 (%)	5.9	6.0	6.4
営業活動によるキャッシュ・フ ロー (百万円)	162,168	89,016	122,563
投資活動によるキャッシュ・フ ロー (百万円)	12,917	26,916	48,635
財務活動によるキャッシュ・フ ロー (百万円)	730	84,739	5,101
現金及び現金同等物の四半期末 (期末)残高 (百万円)	673,946	401,567	603,177

回次	第78期 第2四半期 連結会計期間	第79期 第2四半期 連結会計期間
会計期間	自2019年7月1日 至2019年9月30日	自2020年7月1日 至2020年9月30日
1株当たり四半期純利益金額 (円)	1,602.24	2,848.35

- (注) 1. 当社は四半期連結財務諸表を作成しておりますので、提出会社の主要な経営指標等の推移については記載しておりません。
2. 営業収益には、消費税等は含まれておりません。
3. 潜在株式調整後1株当たり四半期(当期)純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2【事業の内容】

当第2四半期連結累計期間において、当社グループ（当社及び当社の関係会社）が営む事業の内容について、重要な変更はありません。また、主要な関係会社における異動もありません。

なお、当社グループは「投資・金融サービス業」の単一セグメントであるため、セグメントの名称に関する記載を省略しております。

第2【事業の状況】

1【事業等のリスク】

当第2四半期連結累計期間において、新たな事業等のリスクの発生、または、前事業年度の有価証券報告書に記載した事業等のリスクについての重要な変更はありません。

2【経営者による財政状態、経営成績及びキャッシュ・フローの状況の分析】

文中の将来に関する事項は、当四半期連結会計期間の末日現在において判断したものであります。

(1) 財政状態及び経営成績の状況

当第2四半期連結累計期間におけるわが国経済は、新型コロナウイルス感染症拡大の影響により、企業収益は大幅な減少となり、雇用・所得環境及び設備投資には弱さが見られ依然として厳しい状況となりました。社会経済活動が段階的に再開されるとともに輸出や個人消費には持ち直しの動きが見られたものの、国内外で新規感染者数は高止まりしていることより、先行きは不透明な状況が続きました。

日経平均株価は、経済活動の停滞が重荷となりましたが、新型コロナウイルスのワクチン開発の進展を受け、景気回復への期待感が高まったことより大幅に上昇して推移いたしました。国内外で新型コロナウイルスの感染者数が増加していることや外為市場でドル/円が104円台前半まで円高となったことが嫌気され、7月の終値は4ヵ月ぶりに下落いたしました。8月には円高の一服が市場に安心感をもたらしたことに加え、新型コロナウイルスのワクチン開発への期待感からリスクオンの流れとなりました。安倍首相辞任の意向が伝わると一時600円超下げの場面もありましたが、8月の終値は23,139円をつけ、大幅高となりました。9月に入ると国内景気指標が底堅さを示したことを背景に14日の終値は23,559円まで上昇し、2020年2月以来7ヵ月ぶりの水準を回復いたしました。その後は世界的な経済活動の停滞が長引くとの見方が強まり、上値は重い展開となりました。

2020年9月末の日経平均株価は23,185円となり、2020年3月末と比較して22.6%上昇して取引を終えております。

このような環境下であります。当社におきましては、「顧客中心主義」に基づいた魅力ある商品・サービス・手数料体系の提供に努めた結果、当第2四半期連結累計期間には407,441口座の新規口座を獲得し、2020年9月末の総合口座数は5,532,223口座、信用取引口座数は704,689口座となっております。また、預り資産は14兆1,779億円となっております。

業績に関しましては、株式委託売買代金の増加により、当第2四半期連結累計期間の「委託手数料」は21,689百万円（前年同期比61.7%増）、外債販売に係る収益の増加等により「トレーディング損益」は24,605百万円（同64.9%増）となりました。

以上の結果、当第2四半期連結累計期間の業績は、営業収益74,030百万円（前年同期比27.9%増）、純営業収益68,858百万円（同32.5%増）、営業利益27,237百万円（同50.7%増）、経常利益27,316百万円（同49.3%増）、親会社株主に帰属する四半期純利益18,988百万円（同61.8%増）となっております。

当第2四半期連結累計期間の主な取り組みは以下のとおりであります。

- ・株式会社筑邦銀行と2店舗目となる共同店舗の運営を開始（2020年4月）
- ・株式会社高島屋および高島屋ファイナンシャル・パートナーズ株式会社との金融業における業務提携契約を締結（2020年4月）
- ・株式会社三重銀行と2店舗目となる共同店舗の運営を開始（2020年4月）
- ・株式会社南日本銀行との入金サービス「南日本銀行 リアルタイム入金」の提供を開始（2020年4月）
- ・株式会社豊和銀行との入金サービス「豊和銀行 リアルタイム入金」の提供を開始（2020年4月）
- ・機関投資家向けレポート全文をWEBサイトと「SBI証券 株」アプリで個人投資家へ配信を開始（2020年4月）
- ・株式会社広島銀行との金融商品仲介業サービスを開始（2020年4月）
- ・株式会社みちのく銀行との共同店舗の運営及び金融商品仲介業サービスを開始（2020年4月）
- ・最大Tポイント50,000ポイントをプレゼントする「第2回 SBI証券のポイント投資ご紹介キャンペーン」を実施（2020年4月）
- ・SBIグループとSMBCグループが戦略的資本・業務提携に関し基本合意を締結（2020年4月）
- ・初めての先物・オプション取引で最大10万円をキャッシュバックするキャンペーンを実施（2020年5月）
- ・「つみたてNISA」Wキャンペーンとして、つみたてNISA口座の開設で期間固定Tポイント200ポイントをプレゼントし、さらにキャンペーン期間中に初めて「つみたてNISA」で買付を行い、所定の条件達成された方を対象に抽選で100名の方に現金5,000円をプレゼントするキャンペーンを実施（2020年6月）
- ・MAXISに関するクイズ2問に正解した方を対象に抽選で500名の方にMAXISサマーグッズをプレゼントするキャンペーンを実施（2020年6月）
- ・単元未満株（S株）の約定タイミングを1日3回へ拡充（2020年6月）

- ・SBI FX（外国為替保証金取引）の口座数100万口座達成を記念して、抽選で515名の方に総額100万円分のAmazonギフト券が当たる記念キャンペーンを実施（2020年6月）
- ・「ひふみ」シリーズWキャンペーンとして、10万円以上の買付もしくは入庫による条件達成で買付・入庫金額の0.5%相当を還元するキャンペーンと、積立買付における所定の条件達成された方を対象に抽選で1,230名の方にTポイント最大10万ポイントをプレゼントするキャンペーンを実施（2020年6月）
- ・高島屋ファイナンシャル・パートナーズ株式会社との金融商品仲介業サービスを開始（2020年6月）
- ・株式会社筑波銀行との共同店舗の運営及び金融商品仲介業サービスを開始（2020年6月）
- ・株式会社富山銀行との金融商品仲介業サービスを開始（2020年7月）
- ・三井住友カード株式会社と個人向け資産運用サービスにおける業務提携に関する基本合意を締結（2020年7月）
- ・SBIグループとSMBCグループが資本・業務提携契約を締結（2020年7月）
- ・トルコリラ/円、スイスフラン/円の基準スプレッドを縮小し、さらにトルコリラ/円、メキシコペソ/円、シンガポールドル/円、ノルウェークローネ/円、スウェーデンクローナ/円、ポーランドズロチ/円の6通貨ペアのレバレッジ上限の引き上げ（必要保証金率の引き下げ）を実施（2020年8月）
- ・iDeCoの申込みと初回掛金の拠出開始で、抽選で最大100万円分のAmazonギフト券をプレゼントするキャンペーンを実施（2020年8月）
- ・ロボアドバイザー「WealthNavi for SBI証券」残高600億円を達成（2020年8月）
- ・公募増資・売出（PO）銘柄の購入でIPOチャレンジポイントをプレゼントするキャンペーンを実施（2020年8月）
- ・証券総合口座もしくはNISA口座（NISA、つみたてNISA）の新規口座開設で、Tポイント100ポイントをプレゼントするキャンペーンを実施（2020年8月）
- ・株式会社富山銀行との入金サービス「富山銀行 リアルタイム入金」の提供を開始（2020年8月）
- ・株式会社筑波銀行との入金サービス「筑波銀行 リアルタイム入金」の提供を開始（2020年8月）
- ・株式会社宮崎太陽銀行との入金サービス「宮崎太陽銀行 リアルタイム入金」の提供を開始（2020年8月）
- ・株式会社みちのく銀行との入金サービス「みちのく銀行 リアルタイム入金」の提供を開始（2020年8月）
- ・南アランド/円、豪ドル/米ドルの基準スプレッドを縮小（2020年9月）
- ・FXの新規取引数量に応じて最大25万円をキャッシュバックするキャンペーンを実施（2020年9月）
- ・高配当銘柄の取引で現物買付手数料最大3,000円をキャッシュバックするキャンペーンを実施（2020年9月）
- ・最大Tポイント15,000ポイントをプレゼントする「SBI証券のiDeCoご紹介キャンペーン」を実施（2020年9月）
- ・HDI-Japan「問合せ窓口格付け」及び「Webサポート格付け」における「三つ星」を獲得（2020年9月）
- ・大口信用取引における取引手数料無料化の適用条件の引き下げを実施（2020年9月）
- ・株式会社清水銀行とM&A業務に関する提携を開始（2020年9月）

また、業績の概要は以下のとおりであります。

（受入手数料）

当第2四半期連結累計期間は31,240百万円（前年同期比25.7%増）を計上しておりますが、その内訳は以下のとおりであります。

- ・委託手数料
主にインターネットによる株式取引により21,689百万円（同61.7%増）を計上しております。
- ・引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料
株式及び債券の引受け等により485百万円（同68.3%減）を計上しております。
- ・募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料
引き受けた株式の販売等により1,040百万円（同4.1%増）を計上しております。
- ・その他の受入手数料
投資信託の代行手数料等により8,025百万円（同9.8%減）を計上しております。

（トレーディング損益）

FX収益、外債販売に係る収益及び暗号資産取引収益等により24,605百万円（前年同期比64.9%増）を計上しております。

（金融収支）

信用取引の増加により「金融収益」は18,146百万円（前年同期比0.4%増）、「金融費用」は3,711百万円（同5.5%増）となりました。その結果、金融収支は14,434百万円（同0.8%減）となっております。

（販売費及び一般管理費）

当第2四半期連結累計期間における販売費及び一般管理費は41,621百万円（前年同期比22.8%増）は、金融商品仲介業者へ支払う手数料の増加により「事務費」が11,513百万円（同78.3%増）となったこと及び広告宣伝費の増加により「取引関係費」が9,313百万円（同25.4%増）となったこと等によるものであります。

(2) キャッシュ・フローの状況

当第2四半期連結累計期間末における現金及び現金同等物残高は401,567百万円となり、前連結会計年度末の603,177百万円から201,610百万円の減少となりました。

当第2四半期連結累計期間における各キャッシュ・フローの状況とそれらの要因は次のとおりであります。

(営業活動によるキャッシュ・フロー)

営業活動によるキャッシュ・フローは89,016百万円の支出(前年同四半期は162,168百万円の収入)となりました。これは主に、「有価証券担保貸付金及び有価証券担保借入金の増減額」が132,484百万円の収入となった一方で、「信用取引資産及び信用取引負債の増減額」が209,504百万円の支出となったこと等によるものであります。

(投資活動によるキャッシュ・フロー)

投資活動によるキャッシュ・フローは26,916百万円の支出(前年同四半期は12,917百万円の支出)となりました。これは主に、「貸付金の回収による収入」が24,788百万円となった一方で、「貸付けによる支出」が42,094百万円となったこと等によるものであります。

(財務活動によるキャッシュ・フロー)

財務活動によるキャッシュ・フローは84,739百万円の支出(前年同四半期は730百万円の収入)となりました。これは主に、「短期借入金の純増減額」が88,600百万円の支出となったこと等によるものであります。

(3) 経営方針・経営戦略等

当第2四半期連結累計期間において、当社グループが定めている経営方針・経営戦略等について重要な変更はありません。

(4) 事業上及び財務上の対処すべき課題

当第2四半期連結累計期間において、当社グループが対処すべき課題について重要な変更はありません。

(5) 研究開発活動

該当事項はありません。

3 【経営上の重要な契約等】

当第2四半期連結会計期間において、経営上の重要な契約等の決定又は締結等はありません。

第3【提出会社の状況】

1【株式等の状況】

(1)【株式の総数等】

【株式の総数】

種類	発行可能株式総数(株)
普通株式	11,400,000
計	11,400,000

【発行済株式】

種類	第2四半期会計期間末現在発行数(株) (2020年9月30日)	提出日現在発行数(株) (2020年11月12日)	上場金融商品取引所名 又は登録認可金融商品 取引業協会名	内容
普通株式	3,469,559	3,469,559	非上場	当社は単元株制度は採用していません。
計	3,469,559	3,469,559	-	-

(2)【新株予約権等の状況】

【ストックオプション制度の内容】

該当事項はありません。

【その他の新株予約権等の状況】

該当事項はありません。

(3)【行使価額修正条項付新株予約権付社債券等の行使状況等】

該当事項はありません。

(4)【発行済株式総数、資本金等の推移】

年月日	発行済株式総 数増減数 (株)	発行済株式総 数残高(株)	資本金増減額 (百万円)	資本金残高 (百万円)	資本準備金増 減額 (百万円)	資本準備金残 高(百万円)
2020年7月1日～ 2020年9月30日	-	3,469,559	-	48,323	-	15,385

(5)【大株主の状況】

2020年9月30日現在

氏名又は名称	住所	所有株式数 (株)	発行済株式(自己 株式を除く。)の 総数に対する所有 株式数の割合(%)
S B I ファイナンシャルサービ ズ(株)	東京都港区六本木1-6-1	3,469,559	100.00
計	-	3,469,559	100.00

(6)【議決権の状況】
【発行済株式】

2020年9月30日現在

区分	株式数(株)	議決権の数(個)	内容
無議決権株式	-	-	-
議決権制限株式(自己株式等)	-	-	-
議決権制限株式(その他)	-	-	-
完全議決権株式(自己株式等)	-	-	-
完全議決権株式(その他)	普通株式 3,469,559	3,469,559	-
単元未満株式	-	-	-
発行済株式総数	3,469,559	-	-
総株主の議決権	-	3,469,559	-

【自己株式等】

該当事項はありません。

2【役員の状況】

前事業年度の有価証券報告書の提出日後、当四半期累計期間における役員の異動は、次のとおりであります。

(1) 退任役員

役職名	氏名	退任年月日
常務取締役	宇田川 宙	2020年7月31日

(2) 異動後の役員の男女別人数及び女性の比率

男性14名 女性1名(役員のうち女性の比率6.7%)

第4【経理の状況】

1．四半期連結財務諸表の作成方法について

当社の四半期連結財務諸表は、「四半期連結財務諸表の用語、様式及び作成方法に関する規則」（2007年内閣府令第64号）並びに同規則第61条及び第82条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（2007年内閣府令第52号）及び「有価証券関連業経理の統一に関する規則」（1974年11月14日付日本証券業協会自主規制規則）に準拠して作成しております。

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2四半期連結会計期間（2020年7月1日から2020年9月30日まで）及び第2四半期連結累計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）に係る四半期連結財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる四半期レビューを受けております。

1【四半期連結財務諸表】

(1)【四半期連結貸借対照表】

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (2020年3月31日)	当第2四半期連結会計期間 (2020年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	607,200	405,444
預託金	1,726,158	2,003,626
顧客分別金信託	1,522,955	1,777,856
その他の預託金	203,203	225,770
トレーディング商品	155,037	152,600
商品有価証券等	98,743	100,844
デリバティブ取引	56,294	51,755
約定見返勘定	6,484	6,286
信用取引資産	547,987	827,723
信用取引貸付金	435,286	698,061
信用取引借証券担保金	112,701	129,662
有価証券担保貸付金	84,754	231,568
借入有価証券担保金	43,915	221,599
現先取引貸付金	40,838	9,969
立替金	618	218
短期差入保証金	100,511	105,233
支払差金勘定	397	16
関係会社短期貸付金	-	20,000
有価証券	813	-
前払費用	1,515	1,591
未収収益	9,070	11,065
その他	77,866	80,884
貸倒引当金	402	564
流動資産合計	3,318,015	3,845,695
固定資産		
有形固定資産		
建物(純額)	3,373	3,362
工具、器具及び備品(純額)	2,741	3,140
土地	2,802	2,809
リース資産(純額)	684	735
有形固定資産合計	9,602	10,047
無形固定資産		
借地権	0	0
ソフトウェア	12,557	13,014
ソフトウェア仮勘定	2,204	2,944
リース資産	304	197
その他	1,718	1,635
無形固定資産合計	16,785	17,792
投資その他の資産		
投資有価証券	1,834	2,044
出資金	8	16
長期差入保証金	2,269	2,252
長期前払費用	242	209
繰延税金資産	6,575	6,111
その他	4,634	9,948
貸倒引当金	2,355	2,380
投資その他の資産合計	13,210	18,201
固定資産合計	39,597	46,042
資産合計	3,357,613	3,891,738

(単位：百万円)

	前連結会計年度 (2020年3月31日)	当第2四半期連結会計期間 (2020年9月30日)
負債の部		
流動負債		
トレーディング商品	80,534	71,028
商品有価証券等	64,752	58,076
デリバティブ取引	15,782	12,951
信用取引負債	258,350	328,582
信用取引借入金	46,146	87,432
信用取引貸証券受入金	212,204	241,150
有価証券担保借入金	351,701	630,999
有価証券貸借取引受入金	310,901	620,999
現先取引借入金	40,800	10,000
預り金	1,007,976	1,210,994
受入保証金	814,698	871,333
有価証券等受入未了勘定	53	-
受取差金勘定	-	70
短期借入金	490,900	402,300
1年内償還予定の社債	15,588	14,817
リース債務	686	600
未払金	12,967	9,785
未払費用	6,368	6,680
未払法人税等	2,594	2,714
前受金	4,592	3,979
賞与引当金	118	351
その他	7,473	11,405
流動負債合計	3,054,605	3,565,645
固定負債		
社債	51,365	56,400
長期借入金	25,000	25,000
リース債務	746	762
長期預り保証金	135	173
資産除去債務	774	788
繰延税金負債	4	3
固定負債合計	78,025	83,127
特別法上の準備金		
金融商品取引責任準備金	8,464	7,440
特別法上の準備金合計	8,464	7,440
負債合計	3,141,096	3,656,213
純資産の部		
株主資本		
資本金	48,323	48,323
資本剰余金	66,456	66,419
利益剰余金	101,472	120,461
株主資本合計	216,252	235,204
その他の包括利益累計額		
その他有価証券評価差額金	4	9
為替換算調整勘定	433	509
その他の包括利益累計額合計	429	499
非支配株主持分	694	819
純資産合計	216,516	235,525
負債純資産合計	3,357,613	3,891,738

(2) 【四半期連結損益計算書及び四半期連結包括利益計算書】

【四半期連結損益計算書】

【第2四半期連結累計期間】

(単位：百万円)

	前第2四半期連結累計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
営業収益		
受入手数料	24,846	31,240
委託手数料	13,416	21,689
引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘 等の手数料	1,529	485
募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等 の取扱手数料	999	1,040
その他の受入手数料	8,901	8,025
トレーディング損益	14,918	24,605
金融収益	18,070	18,146
その他の営業収益	28	37
営業収益計	57,864	74,030
売上原価		
金融費用	3,516	3,711
その他	2,375	1,459
売上原価合計	5,892	5,171
純営業収益	51,972	68,858
販売費及び一般管理費		
取引関係費	7,426	9,313
人件費	9,654	9,813
不動産関係費	3,199	4,491
事務費	6,458	11,513
減価償却費	2,607	2,899
租税公課	955	1,045
貸倒引当金繰入れ	1,504	191
その他	2,095	2,353
販売費及び一般管理費合計	33,902	41,621
営業利益	18,069	27,237
営業外収益		
受取利息	73	132
受取配当金	5	4
為替差益	104	-
投資事業組合運用益	0	10
補助金収入	-	84
その他	51	42
営業外収益合計	235	274
営業外費用		
支払利息	7	1
為替差損	-	185
投資事業組合運用損	5	3
その他	1	3
営業外費用合計	14	195
経常利益	18,291	27,316

(単位：百万円)

	前第2四半期連結累計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
特別利益		
投資有価証券売却益	65	-
金融商品取引責任準備金戻入	-	1,024
特別利益合計	65	1,024
特別損失		
固定資産除却損	-	60
金融商品取引責任準備金繰入れ	11	-
特別損失合計	11	60
税金等調整前四半期純利益	18,344	28,280
法人税、住民税及び事業税	7,001	8,734
法人税等調整額	812	468
法人税等合計	6,189	9,202
四半期純利益	12,155	19,077
非支配株主に帰属する四半期純利益	421	89
親会社株主に帰属する四半期純利益	11,734	18,988

【四半期連結包括利益計算書】
【第2四半期連結累計期間】

(単位:百万円)

	前第2四半期連結累計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
四半期純利益	12,155	19,077
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	2	5
為替換算調整勘定	241	75
その他の包括利益合計	243	69
四半期包括利益	11,911	19,008
(内訳)		
親会社株主に係る四半期包括利益	11,551	18,919
非支配株主に係る四半期包括利益	360	89

(3)【四半期連結キャッシュ・フロー計算書】

(単位：百万円)

	前第2四半期連結累計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
営業活動によるキャッシュ・フロー		
税金等調整前四半期純利益	18,344	28,280
減価償却費	2,885	3,267
賞与引当金の増減額(は減少)	202	226
貸倒引当金の増減額(は減少)	1,504	188
金融商品取引責任準備金の増減額(は減少)	11	1,024
固定資産除却損	-	60
投資有価証券売却損益(は益)	65	-
受取利息及び受取配当金	18,149	18,283
支払利息	3,524	3,713
為替差損益(は益)	1,484	961
顧客分別金信託の増減額(は増加)	4,800	254,901
その他の預託金の増減額(は増加)	15,940	22,567
短期差入保証金の増減額(は増加)	4,013	4,722
トレーディング商品の増減額	18,654	6,056
信用取引資産及び信用取引負債の増減額	63,167	209,504
受入保証金の増減額(は減少)	52,441	56,634
預り金の増減額(は減少)	82,045	203,018
有価証券担保貸付金及び有価証券担保借入金の増減額	9,564	132,484
その他	2,238	10,043
小計	156,662	98,267
利息及び配当金の受取額	17,767	18,736
利息の支払額	3,474	3,516
法人税等の支払額	8,787	5,969
営業活動によるキャッシュ・フロー	162,168	89,016
投資活動によるキャッシュ・フロー		
有形固定資産の取得による支出	415	946
有形固定資産の売却による収入	-	1
無形固定資産の取得による支出	4,618	3,682
無形固定資産の売却による収入	-	86
投資有価証券の取得による支出	-	219
投資有価証券の売却等による収入	17	24
貸付けによる支出	91,730	42,094
貸付金の回収による収入	86,518	24,788
定期預金の預入による支出	3,704	5,674
定期預金の払戻による収入	1,408	5,725
連結の範囲の変更を伴う子会社株式の取得による収入	224	-
その他	617	4,924
投資活動によるキャッシュ・フロー	12,917	26,916
財務活動によるキャッシュ・フロー		
短期借入金の純増減額(は減少)	10,000	88,600
社債の発行による収入	22,157	16,765
社債の償還による支出	11,145	12,501
非支配株主からの払込みによる収入	135	-
リース債務の返済による支出	416	403
財務活動によるキャッシュ・フロー	730	84,739
現金及び現金同等物に係る換算差額	1,706	937
現金及び現金同等物の増減額(は減少)	148,274	201,610
現金及び現金同等物の期首残高	525,671	603,177
現金及び現金同等物の四半期末残高	673,946	401,567

【注記事項】

(追加情報)

(新型コロナウイルス感染症の影響に関する会計上の見積りについて)

前連結会計年度の有価証券報告書の(追加情報)に記載した新型コロナウイルス感染症の今後の広がり方や収束時期等を含む仮定について重要な変更はありません。

(四半期連結貸借対照表関係)

当社は S B I ホールディングス(株)及び(株)ライブスター証券と極度貸付契約を締結しております。この契約に基づく貸出未実行残高は次のとおりであります。

(1) S B I ホールディングス(株)

	前連結会計年度 (2020年3月31日)	当第2四半期連結会計期間 (2020年9月30日)
極度額	30,000百万円	30,000百万円
貸出実行残高	-	20,000
差引額	30,000	10,000

(2) (株)ライブスター証券

	前連結会計年度 (2020年3月31日)	当第2四半期連結会計期間 (2020年9月30日)
極度額	-	10,000百万円
貸出実行残高	-	4,300
差引額	-	5,700

また、当社の子会社である S B I リクイディティ・マーケット(株)は S B I レミット(株)と極度貸付契約を締結しております。この契約に基づく貸出未実行残高は次のとおりであります。

	前連結会計年度 (2020年3月31日)	当第2四半期連結会計期間 (2020年9月30日)
極度額	1,632百万円	1,587百万円
貸出実行残高	-	-
差引額	1,632	1,587

(四半期連結キャッシュ・フロー計算書関係)

現金及び現金同等物の四半期末残高と四半期連結貸借対照表に掲記されている科目の金額との関係は次のとおりであります。

	前第2四半期連結累計期間 (自2019年4月1日 至2019年9月30日)	当第2四半期連結累計期間 (自2020年4月1日 至2020年9月30日)
現金及び預金勘定	677,661百万円	405,444百万円
預入期間が3か月を超える定期預金	3,715	3,876
現金及び現金同等物	673,946	401,567

(セグメント情報等)

【セグメント情報】

当社グループは、「投資・金融サービス業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(1 株当たり情報)

1 株当たり四半期純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前第 2 四半期連結累計期間 (自 2019年 4 月 1 日 至 2019年 9 月30日)	当第 2 四半期連結累計期間 (自 2020年 4 月 1 日 至 2020年 9 月30日)
1 株当たり四半期純利益金額	3,382円07銭	5,472円98銭
(算定上の基礎)		
親会社株主に帰属する四半期純利益金額 (百万円)	11,734	18,988
普通株主に帰属しない金額 (百万円)	-	-
普通株式に係る親会社株主に帰属する四半期純利益金額 (百万円)	11,734	18,988
普通株式の期中平均株式数 (株)	3,469,559	3,469,559

(注) 潜在株式調整後 1 株当たり四半期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

(重要な後発事象)

(子会社株式の売却)

当社は、2020年10月開催の取締役会において、当社が保有する子会社株式を売却することを決議いたしました。これにより、2021年 3 月期第 3 四半期連結会計期間に関係会社株式売却益 (特別利益) を計上いたします。

(1) 子会社株式の売却理由

S B I ホールディングス(株) (以下、同社グループを総称して「 S B I グループ」) 及び当社は、2020年 4 月 28日に(株)三井住友フィナンシャルグループ (以下、同社グループを総称して「 S M B C グループ」) 及び(株)三井住友銀行と戦略的資本・業務提携に関して基本合意書を締結し、その実現に向けた検討を進めてまいりました。

2020年 7 月30日には、 S B I グループと S M B C グループは、両グループの有する幅広い顧客基盤や金融商品・サービスの活用等による「新たな資産形成機会の提供」と「多様化するニーズに応えるサービスの開発」等の検討をさらに高度化するため、資本提携を実施いたしました。

具体的には、(株) S B I ネオモバイル証券が(株)三井住友フィナンシャルグループに対し第三者割当による新株式の発行を実施いたします。これにより、(株)三井住友フィナンシャルグループは(株) S B I ネオモバイル証券の 20%の株式を保有することとなります。

また、当資本提携の一環として、当社が保有する(株) S B I ネオモバイル証券の株式を S B I ホールディングス(株)及び S B I ファイナンシャルサービシーズ(株)へ譲渡することといたしました。

(2) 子会社株式の売却の内容

売却する相手会社の名称	S B I ホールディングス(株)及び S B I ファイナンシャルサービシーズ(株)
売却の時期	2020年11月
子会社の名称	(株) S B I ネオモバイル証券
子会社の事業内容	若年層をターゲットとしたスマホ証券事業
売却する株式の数	1,085,000株
売却価額	10,850百万円
売却益	6,149百万円
売却後の持分比率	- %

2 【その他】

該当事項はありません。

第二部【提出会社の保証会社等の情報】

第1【保証会社情報】

該当事項はありません。

第2【保証会社以外の会社の情報】

本「第2 保証会社以外の会社の情報」中の「1 当該会社の情報の開示を必要とする理由」及び「2 継続開示会社たる当該会社に関する事項」については、2020年9月30日までに公開されている情報に基づき記載しています。

1【当該会社の情報の開示を必要とする理由】

1. 株式会社SBI証券2020年12月29日満期早期償還条項付/他社株転換条項付 円建社債（三井不動産株式会社）

(1) 発行日

2019年6月25日

(2) 売出価額の総額

200百万円

(3) 対象銘柄の発行会社の名称および住所

三井不動産株式会社

東京都中央区日本橋室町二丁目1番1号

(4) 理由

三井不動産株式会社は、対象銘柄の発行会社であり、上記1.に記載の社債は、当該社債の要項に規定された条件に従い、ある早期償還判定日（最終償還判定日を除く。）における対象銘柄の終値が早期償還判定水準以上となった場合、額面金額で早期償還され、また、当該社債の要項に規定された条件に従い、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象銘柄終値がその行使価格以上となる場合には額面金額の100%で最終償還され、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象銘柄の終値が行使価格未満である場合には、対象銘柄株数の交付等により最終償還される。したがって、対象銘柄の情報は、当該社債の投資判断に重要な影響を及ぼすと考えられる。但し、当該社債の発行会社、売出人その他の当該社債の発行に係る関係者は、独自に対象銘柄の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

(5) 対象銘柄についての詳細

種類	発行済株式数	上場金融商品取引所又は 登録認可金融商品取引業協会名	内容
	(2020年8月13日現在)		
普通株式	979,387,277株	東京証券取引所 (市場第一部)	単元株式数 100株

(注) 1. 「発行済株式数」には、2020年8月1日から2020年8月13日までの新株予約権の行使により発行された株式数は含まれていない。

2. 2020年6月26日開催の取締役会において決議した譲渡制限付株式報酬としての新株式の発行により、2020年7月22日付で137,050株増加。

2. 株式会社SBI証券2021年12月6日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

(1) 発行日

2019年12月5日

(2) 売出価額の総額

700百万円

(3) 対象銘柄の発行会社の名称および住所

野村アセットマネジメント株式会社

東京都中央区日本橋一丁目12番1号

(4) 理由

野村アセットマネジメント株式会社は、NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信（銘柄コード：1570.T）の受益権を表章する受益証券（以下「対象受益証券」という。）の発行会社であり、上記2.に記載の社債は、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ある早期償還判定日（最終償還判定日を除く。）における対象受益証券の終値が早期償還判定水準以上になった場

合、元本金額で早期償還され、また、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象受益証券の終値が行使価格未満になった場合、対象受益証券口数の交付等により満期償還される。したがって、対象受益証券の情報は、当該社債の投資判断に重要な影響を及ぼすと考えられる。但し、当該社債の発行会社、売出人その他の当該社債の発行に係る関係者は、独自に対象受益証券の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

(5) 対象銘柄についての詳細

種類	受益権残存口数	上場金融商品取引所又は 登録認可金融商品取引業協会名	内容
	(2020年9月29日現在)		
証券投資信託の受益権	11,520,000口	東京証券取引所	売買単位1口

3. 株式会社SBI証券2021年12月10日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

(1) 発行日

2019年12月9日

(2) 売出価額の総額

700百万円

(3) 対象銘柄の発行会社の名称および住所

野村アセットマネジメント株式会社
東京都中央区日本橋一丁目12番1号

(4) 理由

野村アセットマネジメント株式会社は、NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信（銘柄コード：1570.T）の受益権を表章する受益証券（以下「対象受益証券」という。）の発行会社であり、上記3.に記載の社債は、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ある早期償還判定日（最終償還判定日を除く。）における対象受益証券の終値が早期償還判定水準以上になった場合、元本金額で早期償還され、また、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象受益証券の終値が行使価格未満になった場合、対象受益証券口数の交付等により満期償還される。したがって、対象受益証券の情報は、当該社債の投資判断に重要な影響を及ぼすと考えられる。但し、当該社債の発行会社、売出人その他の当該社債の発行に係る関係者は、独自に対象受益証券の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

(5) 対象銘柄についての詳細

種類	受益権残存口数	上場金融商品取引所又は 登録認可金融商品取引業協会名	内容
	(2020年9月29日現在)		
証券投資信託の受益権	11,520,000口	東京証券取引所	売買単位1口

4. 株式会社SBI証券2021年12月17日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

(1) 発行日

2019年12月16日

(2) 売出価額の総額

700百万円

(3) 対象銘柄の発行会社の名称および住所

野村アセットマネジメント株式会社
東京都中央区日本橋一丁目12番1号

(4) 理由

野村アセットマネジメント株式会社は、NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信（銘柄コード：1570.T）の受益権を表章する受益証券（以下「対象受益証券」という。）の発行会社であり、上記4.に記載の社債は、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ある早期償還判定日（最終償還判定日を除く。）における対象受益証券の終値が早期償還判定水準以上になった場

合、元本金額で早期償還され、また、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象受益証券の終値が行使価格未満になった場合、対象受益証券口数の交付等により満期償還される。したがって、対象受益証券の情報は、当該社債の投資判断に重要な影響を及ぼすと考えられる。但し、当該社債の発行会社、売出人その他の当該社債の発行に係る関係者は、独自に対象受益証券の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

(5) 対象銘柄についての詳細

種類	受益権残存口数	上場金融商品取引所又は 登録認可金融商品取引業協会名	内容
	(2020年9月29日現在)		
証券投資信託の受益権	11,520,000口	東京証券取引所	売買単位1口

5. 株式会社SBI証券2021年6月24日満期早期償還条項付/他社株転換条項付 円建社債(株式会社良品計画)

(1) 発行日

2019年12月23日

(2) 売出価額の総額

300百万円

(3) 対象銘柄の発行会社の名称および住所

株式会社良品計画

東京都豊島区東池袋四丁目26番3号

(4) 理由

株式会社良品計画は、対象銘柄の発行会社であり、上記5.に記載の社債は、当該社債の要項に規定された条件に従い、ある早期償還判定日(最終償還判定日を除く。)における対象銘柄の終値が早期償還判定水準以上となった場合、額面金額で早期償還され、また、当該社債の要項に規定された条件に従い、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象銘柄終値がその行使価格以上となる場合には額面金額の100%で最終償還され、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象銘柄の終値が行使価格未満である場合には、対象銘柄株数の交付等により最終償還される。したがって、対象銘柄の情報は、当該社債の投資判断に重要な影響を及ぼすと考えられる。但し、当該社債の発行会社、売出人その他の当該社債の発行に係る関係者は、独自に対象銘柄の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

(5) 対象銘柄についての詳細

種類	発行済株式数	上場金融商品取引所又は 登録認可金融商品取引業協会名	内容
	(2020年7月13日現在)		
普通株式	280,780,000株	東京証券取引所 (市場第一部)	単元株式数 100株

6. 株式会社SBI証券2021年12月23日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

(1) 発行日

2019年12月23日

(2) 売出価額の総額

400百万円

(3) 対象銘柄の発行会社の名称および住所

野村アセットマネジメント株式会社

東京都中央区日本橋一丁目12番1号

(4) 理由

野村アセットマネジメント株式会社は、NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信(銘柄コード:1570.T)の受益権を表章する受益証券(以下「対象受益証券」という。)の発行会社であり、上記6.に記載の社債は、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ある早期償還判定日(最終償還判定日を除く。)における対象受益証券の終値が早期償還判定水準以上になった場合、元本金額で早期償還され、また、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象受益証券の終値が行使価格未満になった場合、対象受益証券口数の交付等により満期償還される。したがって、対象受益証券の情報は、当該社債の投

資判断に重要な影響を及ぼすと考えられる。但し、当該社債の発行会社、売出人その他の当該社債の発行に係る関係者は、独自に対象受益証券の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

(5) 対象銘柄についての詳細

種類	受益権残存口数	上場金融商品取引所又は 登録認可金融商品取引業協会名	内容
	(2020年9月29日現在)		
証券投資信託の受益権	11,520,000口	東京証券取引所	売買単位1口

7. 株式会社SBI証券2022年1月7日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

(1) 発行日

2020年1月6日

(2) 売出価額の総額

800百万円

(3) 対象銘柄の発行会社の名称および住所

野村アセットマネジメント株式会社
東京都中央区日本橋一丁目12番1号

(4) 理由

野村アセットマネジメント株式会社は、NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信（銘柄コード：1570.T）の受益権を表章する受益証券（以下「対象受益証券」という。）の発行会社であり、上記7.に記載の社債は、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ある早期償還判定日（最終償還判定日を除く。）における対象受益証券の終値が早期償還判定水準以上になった場合、元本金額で早期償還され、また、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象受益証券の終値が行使価格未満になった場合、対象受益証券口数の交付等により満期償還される。したがって、対象受益証券の情報は、当該社債の投資判断に重要な影響を及ぼすと考えられる。但し、当該社債の発行会社、売出人その他の当該社債の発行に係る関係者は、独自に対象受益証券の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

(5) 対象銘柄についての詳細

種類	受益権残存口数	上場金融商品取引所又は 登録認可金融商品取引業協会名	内容
	(2020年9月29日現在)		
証券投資信託の受益権	11,520,000口	東京証券取引所	売買単位1口

8. 株式会社SBI証券2022年1月11日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

(1) 発行日

2020年1月9日

(2) 売出価額の総額

700百万円

(3) 対象銘柄の発行会社の名称および住所

野村アセットマネジメント株式会社
東京都中央区日本橋一丁目12番1号

(4) 理由

野村アセットマネジメント株式会社は、NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信（銘柄コード：1570.T）の受益権を表章する受益証券（以下「対象受益証券」という。）の発行会社であり、上記8.に記載の社債は、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ある早期償還判定日（最終償還判定日を除く。）における対象受益証券の終値が早期償還判定水準以上になった場合、元本金額で早期償還され、また、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象受益証券の終値が行使価格未満になった場合、対象受益証券口数の交付等により満期償還される。したがって、対象受益証券の情報は、当該社債の投

資判断に重要な影響を及ぼすと考えられる。但し、当該社債の発行会社、売出人その他の当該社債の発行に係る関係者は、独自に対象受益証券の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

(5) 対象銘柄についての詳細

種類	受益権残存口数	上場金融商品取引所又は 登録認可金融商品取引業協会名	内容
	(2020年9月29日現在)		
証券投資信託の受益権	11,520,000口	東京証券取引所	売買単位1口

9. 株式会社SBI証券2021年7月15日満期早期償還条項付/他社株転換条項付 円建社債(三菱電機株式会社)

(1) 発行日

2020年1月14日

(2) 売出価額の総額

500百万円

(3) 対象銘柄の発行会社の名称および住所

三菱電機株式会社

東京都千代田区丸の内二丁目7番3号

(4) 理由

三菱電機株式会社は、対象銘柄の発行会社であり、上記9.に記載の社債は、当該社債の要項に規定された条件に従い、ある早期償還判定日(最終償還判定日を除く。)における対象銘柄の終値が早期償還判定水準以上となった場合、額面金額で早期償還され、また、当該社債の要項に規定された条件に従い、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象銘柄終値がその行使価格以上となる場合には額面金額の100%で最終償還され、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象銘柄の終値が行使価格未満である場合には、対象銘柄株数の交付等により最終償還される。したがって、対象銘柄の情報は、当該社債の投資判断に重要な影響を及ぼすと考えられる。但し、当該社債の発行会社、売出人その他の当該社債の発行に係る関係者は、独自に対象銘柄の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

(5) 対象銘柄についての詳細

種類	発行済株式数	上場金融商品取引所又は 登録認可金融商品取引業協会名	内容
	(2020年8月12日現在)		
普通株式	2,147,201,551株	国内:東京(市場第一部) 海外:ロンドン	単元株式数 100株

(注)上記普通株式は、議決権を有している。

10. 株式会社SBI証券2022年1月17日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債

(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

(1) 発行日

2020年1月15日

(2) 売出価額の総額

800百万円

(3) 対象銘柄の発行会社の名称および住所

野村アセットマネジメント株式会社

東京都中央区日本橋一丁目12番1号

(4) 理由

野村アセットマネジメント株式会社は、NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信(銘柄コード:1570.T)の受益権を表章する受益証券(以下「対象受益証券」という。)の発行会社であり、上記10.に記載の社債は、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ある早期償還判定日(最終償還判定日を除く。)における対象受益証券の終値が早期償還判定水準以上になった場合、元本金額で早期償還され、また、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象受益証券の終値が行使価格未満になった場合、対象受益証券口数の交付等により満期償還される。したがって、対象受益証券の情報は、当該社債の投資判断に重要な影響を及ぼすと考えられる。但し、当該社債の発行会社、売出人その他の当該社債の発行に係る関係者は、独自に対象受益証券の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

る関係者は、独自に対象受益証券の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

(5) 対象銘柄についての詳細

種類	受益権残存口数	上場金融商品取引所又は 登録認可金融商品取引業協会名	内容
	(2020年9月29日現在)		
証券投資信託の受益権	11,520,000口	東京証券取引所	売買単位1口

11. 株式会社SBI証券2022年1月17日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

(1) 発行日

2020年1月16日

(2) 売出価額の総額

500百万円

(3) 対象銘柄の発行会社の名称および住所

野村アセットマネジメント株式会社
東京都中央区日本橋一丁目12番1号

(4) 理由

野村アセットマネジメント株式会社は、NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信（銘柄コード：1570.T）の受益権を表章する受益証券（以下「対象受益証券」という。）の発行会社であり、上記11.に記載の社債は、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ある早期償還判定日（最終償還判定日を除く。）における対象受益証券の終値が早期償還判定水準以上になった場合、元本金額で早期償還され、また、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象受益証券の終値が行使価格未満になった場合、対象受益証券口数の交付等により満期償還される。したがって、対象受益証券の情報は、当該社債の投資判断に重要な影響を及ぼすと考えられる。但し、当該社債の発行会社、売出人その他の当該社債の発行に係る関係者は、独自に対象受益証券の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

(5) 対象銘柄についての詳細

種類	受益権残存口数	上場金融商品取引所又は 登録認可金融商品取引業協会名	内容
	(2020年9月29日現在)		
証券投資信託の受益権	11,520,000口	東京証券取引所	売買単位1口

12. 株式会社SBI証券2022年4月1日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均ダブルインバース・インデックス連動型上場投信)

(1) 発行日

2020年3月30日

(2) 売出価額の総額

200百万円

(3) 対象銘柄の発行会社の名称および住所

野村アセットマネジメント株式会社
東京都中央区日本橋一丁目12番1号

(4) 理由

野村アセットマネジメント株式会社は、NEXT FUNDS 日経平均ダブルインバース・インデックス連動型上場投信（銘柄コード：1357.T）の受益権を表章する受益証券（以下「対象受益証券」という。）の発行会社であり、上記12.に記載の社債は、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ある早期償還判定日（最終償還判定日を除く。）における対象受益証券の終値が早期償還判定水準以上になった場合、元本金額で早期償還され、また、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象受益証券の終値が行使価格未満になった場合、対象受益証券口数の交付等により満期償還される。したがって、対象受益証券の情報は、当該社債の投資判断に重要な影響を及ぼすと考えられる。但し、当該社債の発行会社、売出人その他の当該社債の

発行に係る関係者は、独自に対象受益証券の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

(5) 対象銘柄についての詳細

種類	受益権残存口数	上場金融商品取引所又は 登録認可金融商品取引業協会名	内容
	(2020年9月29日現在)		
証券投資信託の受益権	414,380,000口	東京証券取引所	売買単位1口

13. 株式会社SBI証券2020年10月16日満期早期償還条項付/他社株転換条項付 円建社債(三菱地所株式会社)

(1) 発行日

2020年4月15日

(2) 売出価額の総額

300百万円

(3) 対象銘柄の発行会社の名称および住所

三菱地所株式会社

東京都千代田区大手町一丁目1番1号

(4) 理由

三菱地所株式会社は、対象銘柄の発行会社であり、上記13.に記載の社債は、当該社債の要項に規定された条件に従い、ある早期償還判定日(最終償還判定日を除く。)における対象銘柄の終値が早期償還判定水準以上となった場合、額面金額で早期償還され、また、当該社債の要項に規定された条件に従い、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象銘柄終値がその行使価格以上となる場合には額面金額の100%で最終償還され、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象銘柄の終値が行使価格未満である場合には、対象銘柄株数の交付等により最終償還される。したがって、対象銘柄の情報は、当該社債の投資判断に重要な影響を及ぼすと考えられる。但し、当該社債の発行会社、売出人その他の当該社債の発行に係る関係者は、独自に対象銘柄の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

(5) 対象銘柄についての詳細

種類	発行済株式数	上場金融商品取引所又は 登録認可金融商品取引業協会名	内容
	(2020年8月14日現在)		
普通株式	1,391,328,316株	東京証券取引所 名古屋証券取引所 各市場第一部	単元株式数は100株

(注)「発行済株式数」欄には、2020年8月1日から2020年8月14日までの新株予約権の行使により発行された株式数は含まない。

14. 株式会社SBI証券2022年6月6日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

(1) 発行日

2020年6月4日

(2) 売出価額の総額

500百万円

(3) 対象銘柄の発行会社の名称および住所

野村アセットマネジメント株式会社

東京都中央区日本橋一丁目12番1号

(4) 理由

野村アセットマネジメント株式会社は、NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信(銘柄コード:1570.T)の受益権を表章する受益証券(以下「対象受益証券」という。)の発行会社であり、上記14.に記載の社債は、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ある早期償還判定日(最終償還判定日を除く。)における対象受益証券の終値が早期償還判定水準以上になった場合、元本金額で早期償還され、また、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象受益証券の終値が行使価格未満になった場合、対象受益証券口数の交付等により満期償還される。したがって、対象受益証券の情報は、当該社債の投資判断に重要な影響を及ぼすと考えられる。但し、当該社債の発行会社、売出人その他の当該社債の発行に係

る関係者は、独自に対象受益証券の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

(5) 対象銘柄についての詳細

種類	受益権残存口数	上場金融商品取引所又は 登録認可金融商品取引業協会名	内容
	(2020年9月29日現在)		
証券投資信託の受益権	11,520,000口	東京証券取引所	売買単位1口

15. 株式会社SBI証券2022年6月17日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

(1) 発行日

2020年6月16日

(2) 売出価額の総額

500百万円

(3) 対象銘柄の発行会社の名称および住所

野村アセットマネジメント株式会社
東京都中央区日本橋一丁目12番1号

(4) 理由

野村アセットマネジメント株式会社は、NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信（銘柄コード：1570.T）の受益権を表章する受益証券（以下「対象受益証券」という。）の発行会社であり、上記15.に記載の社債は、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ある早期償還判定日（最終償還判定日を除く。）における対象受益証券の終値が早期償還判定水準以上になった場合、元本金額で早期償還され、また、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象受益証券の終値が行使価格未満になった場合、対象受益証券口数の交付等により満期償還される。したがって、対象受益証券の情報は、当該社債の投資判断に重要な影響を及ぼすと考えられる。但し、当該社債の発行会社、売出人その他の当該社債の発行に係る関係者は、独自に対象受益証券の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

(5) 対象銘柄についての詳細

種類	受益権残存口数	上場金融商品取引所又は 登録認可金融商品取引業協会名	内容
	(2020年9月29日現在)		
証券投資信託の受益権	11,520,000口	東京証券取引所	売買単位1口

16. 株式会社SBI証券2020年12月23日満期早期償還条項付/他社株転換条項付 円建社債（日本電信電話株式会社）

(1) 発行日

2020年6月23日

(2) 売出価額の総額

300百万円

(3) 対象銘柄の発行会社の名称および住所

日本電信電話株式会社
東京都千代田区大手町一丁目5番1号

(4) 理由

日本電信電話株式会社は、対象銘柄の発行会社であり、上記16.に記載の社債は、当該社債の要項に規定された条件に従い、ある早期償還判定日（最終償還判定日を除く。）における対象銘柄の終値が早期償還判定水準以上となった場合、額面金額で早期償還され、また、当該社債の要項に規定された条件に従い、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象銘柄終値がその行使価格以上となる場合には額面金額の100%で最終償還され、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象銘柄の終値が行使価格未満である場合には、対象銘柄株数の交付等により最終償還される。したがって、対象銘柄の情報は、当該社債の投資判断に重要な影響を及ぼすと考えられる。但し、当該社債の発行会社、売出人その他の当該社債の発行に係る関係者は、独自に対象銘柄の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

(5) 対象銘柄についての詳細

種類	発行済株式数	上場金融商品取引所又は 登録認可金融商品取引業協会名	内容
	(2020年8月12日現在)		
普通株式	3,900,788,940株	東京証券取引所 (市場第一部)	単元株式数 100株

17. 株式会社 S B I 証券2022年7月15日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

(1) 発行日

2020年7月14日

(2) 売出価額の総額

500百万円

(3) 対象銘柄の発行会社の名称および住所

野村アセットマネジメント株式会社
東京都中央区日本橋一丁目12番1号

(4) 理由

野村アセットマネジメント株式会社は、NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信（銘柄コード：1570.T）の受益権を表章する受益証券（以下「対象受益証券」という。）の発行会社であり、上記17.に記載の社債は、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ある早期償還判定日（最終償還判定日を除く。）における対象受益証券の終値が早期償還判定水準以上になった場合、元本金額で早期償還され、また、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象受益証券の終値が行使価格未満になった場合、対象受益証券口数の交付等により満期償還される。したがって、対象受益証券の情報は、当該社債の投資判断に重要な影響を及ぼすと考えられる。但し、当該社債の発行会社、売出人その他の当該社債の発行に係る関係者は、独自に対象受益証券の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

(5) 対象銘柄についての詳細

種類	受益権残存口数	上場金融商品取引所又は 登録認可金融商品取引業協会名	内容
	(2020年9月29日現在)		
証券投資信託の受益権	11,520,000口	東京証券取引所	売買単位1口

18. 株式会社 S B I 証券2021年1月15日満期早期償還条項付/他社株転換条項付 円建社債（Zホールディングス株式会社）

(1) 発行日

2020年7月14日

(2) 売出価額の総額

300百万円

(3) 対象銘柄の発行会社の名称および住所

Zホールディングス株式会社
東京都千代田区紀尾井町1番3号

(4) 理由

Zホールディングス株式会社は、対象銘柄の発行会社であり、上記18.に記載の社債は、当該社債の要項に規定された条件に従い、ある早期償還判定日（最終償還判定日を除く。）における対象銘柄の終値が早期償還判定水準以上となった場合、額面金額で早期償還され、また、当該社債の要項に規定された条件に従い、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象銘柄終値がその行使価格以上となる場合には額面金額の100%で最終償還され、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象銘柄の終値が行使価格未満である場合には、対象銘柄株数の交付等により最終償還される。したがって、対象銘柄の情報は、当該社債の投資判断に重要な影響を及ぼすと考えられる。但し、当該社債の発行会社、売出人その他の当該社債の発行に係る関係者は、独自に対象銘柄の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

(5) 対象銘柄についての詳細

種類	発行済株式数	上場金融商品取引所又は 登録認可金融商品取引業協会名	内容
	(2020年8月7日現在)		
普通株式	4,823,801,565株	東京証券取引所 (市場第一部)	単元株式数は100株

(注)発行済株式数には、2020年8月1日から2020年8月7日までの新株予約権の行使により発行された株式数は含まれていない。また、2020年7月17日付で金銭報酬債権および金銭債権(合計488,287,500円)を出資財産とする譲渡制限付株式報酬として、普通株式1,122,500株を発行。

19. 株式会社SBI証券2022年8月12日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

(1) 発行日

2020年8月12日

(2) 売出価額の総額

400百万円

(3) 対象銘柄の発行会社の名称および住所

野村アセットマネジメント株式会社
東京都中央区日本橋一丁目12番1号

(4) 理由

野村アセットマネジメント株式会社は、NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信(銘柄コード:1570.T)の受益権を表章する受益証券(以下「対象受益証券」という。)の発行会社であり、上記19.に記載の社債は、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ある早期償還判定日(最終償還判定日を除く。)における対象受益証券の終値が早期償還判定水準以上になった場合、元本金額で早期償還され、また、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象受益証券の終値が行使価格未満になった場合、対象受益証券口数の交付等により満期償還される。したがって、対象受益証券の情報は、当該社債の投資判断に重要な影響を及ぼすと考えられる。但し、当該社債の発行会社、売出人その他の当該社債の発行に係る関係者は、独自に対象受益証券の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

(5) 対象銘柄についての詳細

種類	受益権残存口数	上場金融商品取引所又は 登録認可金融商品取引業協会名	内容
	(2020年9月29日現在)		
証券投資信託の受益権	11,520,000口	東京証券取引所	売買単位1口

20. 株式会社SBI証券2022年9月2日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

(1) 発行日

2020年9月1日

(2) 売出価額の総額

500百万円

(3) 対象銘柄の発行会社の名称および住所

野村アセットマネジメント株式会社
東京都中央区日本橋一丁目12番1号

(4) 理由

野村アセットマネジメント株式会社は、NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信(銘柄コード:1570.T)の受益権を表章する受益証券(以下「対象受益証券」という。)の発行会社であり、上記20.に記載の社債は、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ある早期償還判定日(最終償還判定日を除く。)における対象受益証券の終値が早期償還判定水準以上になった場合、元本金額で早期償還され、また、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象受益証券の終値が行使価格未満になった場合、対象受益証券口数の交付等により満期償還される。したがって、対象受益証券の情報は、当該社債の投資判断に重要な影響を及ぼすと考えられる。但し、当該社債の発行会社、売出人その他の当該社債の発行に係

る関係者は、独自に対象受益証券の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

(5) 対象銘柄についての詳細

種類	受益権残存口数	上場金融商品取引所又は 登録認可金融商品取引業協会名	内容
	(2020年9月29日現在)		
証券投資信託の受益権	11,520,000口	東京証券取引所	売買単位1口

21. 株式会社SBI証券2021年3月4日満期早期償還条項付/他社株式株価連動 円建社債(任天堂株式会社)

(1) 発行日

2020年9月3日

(2) 売出価額の総額

300百万円

(3) 対象銘柄の発行会社の名称および住所

任天堂株式会社

京都市南区上鳥羽鉾立町11番地1

(4) 理由

任天堂株式会社は、対象銘柄の発行会社であり、上記21.に記載の社債は、当該社債の要項に規定された条件に従い、ある早期償還判定日(最終償還判定日を除く。)における対象銘柄の終値が早期償還判定水準以上となった場合、額面金額で早期償還され、また、当該社債の要項に規定された条件に従い、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象銘柄終値がその行使価格以上となる場合には額面金額の100%で最終償還され、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象銘柄終値がその行使価格未満である場合には、額面金額×(最終償還判定日における対象銘柄終値÷行使価格)の算式により算出される金額で最終償還される。したがって、対象銘柄の情報は、当該社債の投資判断に重要な影響を及ぼすと考えられる。但し、当該社債の発行会社、売出人その他の当該社債の発行に係る関係者は、独自に対象銘柄の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

(5) 対象銘柄についての詳細

種類	発行済株式数	上場金融商品取引所又は 登録認可金融商品取引業協会名	内容
	(2020年8月12日現在)		
普通株式	131,669,000株	東京証券取引所 (市場第一部)	単元株式数は100株

22. 株式会社SBI証券2021年9月3日満期複数株式参照型早期償還条項付/他社株式株価連動 デジタルクーポン 円建社債(TDK株式会社、三菱地所株式会社)

(1) 発行日

2020年9月2日

(2) 売出価額の総額

300百万円

(3) 対象銘柄の発行会社の名称および住所

A TDK株式会社

東京都中央区日本橋二丁目5番1号

B 三菱地所株式会社

東京都千代田区大手町一丁目1番1号

(4) 理由

A TDK株式会社

TDK株式会社は、対象銘柄の発行会社であり、上記22.に記載の社債は、当該社債の要項に規定された条件に従い、ある早期償還判定日(最終償還判定日を除く。)におけるすべての対象銘柄終値がそれぞれ早期償還判定水準以上になった場合、額面金額で早期償還され、また、当該社債の要項に規定された条件に従い、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日におけるすべての対象銘柄終値がその行使価格以上となる場合には額面金額の100%で最終償還され、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象銘柄終値のいずれかがその行使価格未満である場合には、額面金額×(ワーストパフォーマンス株式の最終償還判定日における対象銘柄終値÷ワーストパフォーマンス株式の行使価格)の算式により算出される金額で最終償還され

る。したがって、対象銘柄の情報は、本社債の投資判断に重要な影響を及ぼすと考えられる。ただし、本社債の発行会社、売出人その他の本社債の発行に係る関係者は、独自に当該株式の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

B 三菱地所株式会社

三菱地所株式会社は、対象銘柄の発行会社であり、上記22.に記載の社債は、当該社債の要項に規定された条件に従い、ある早期償還判定日（最終償還判定日を除く。）におけるすべての対象銘柄終値がそれぞれ早期償還判定水準以上になった場合、額面金額で早期償還され、また、当該社債の要項に規定された条件に従い、ノックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日におけるすべての対象銘柄終値がその行使価格以上となる場合には額面金額の100%で最終償還され、ノックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象銘柄終値のいずれかがその行使価格未満である場合には、額面金額×（ワーストパフォーマンス株式の最終償還判定日における対象銘柄終値÷ワーストパフォーマンス株式の行使価格）の算式により算出される金額で最終償還される。したがって、対象銘柄の情報は、本社債の投資判断に重要な影響を及ぼすと考えられる。ただし、本社債の発行会社、売出人その他の本社債の発行に係る関係者は、独自に当該株式の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

(5) 対象銘柄についての詳細

A TDK株式会社

種類	発行済株式数	上場金融商品取引所又は 登録認可金融商品取引業協会名	内容
	(2020年8月7日現在)		
普通株式	129,590,659株	東京証券取引所(市場第一部)	単元株式数は100株

(注)「発行済株式数」には、2020年8月1日から2020年8月7日までの新株予約権の行使により発行された株式数は含まれていない。

B 三菱地所株式会社

種類	発行済株式数	上場金融商品取引所又は 登録認可金融商品取引業協会名	内容
	(2020年8月14日現在)		
普通株式	1,391,328,316株	東京証券取引所 名古屋証券取引所 各市場第一部	単元株式数は100株

(注)「発行済株式数」には、2020年8月1日から2020年8月14日までの新株予約権の行使により発行された株式数は含まれていない。

23. 株式会社SBI証券2022年9月22日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

(1) 発行日

2020年9月23日

(2) 売出価額の総額

500百万円

(3) 対象銘柄の発行会社の名称および住所

野村アセットマネジメント株式会社
東京都中央区日本橋一丁目12番1号

(4) 理由

野村アセットマネジメント株式会社は、NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信（銘柄コード：1570.T）の受益権を表章する受益証券（以下「対象受益証券」という。）の発行会社であり、上記23.に記載の社債は、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ある早期償還判定日（最終償還判定日を除く。）における対象受益証券の終値が早期償還判定水準以上になった場合、元本金額で早期償還され、また、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ノックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象受益証券の終値が行使価格未満になった場合、対象受益証券口数の交付等により満期償還される。したがって、対象受益証券の情報は、当該社債の投資判断に重要な影響を及ぼすと考えられる。但し、当該社債の発行会社、売出人その他の当該社債の発行に係る関係者は、独自に対象受益証券の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

(5) 対象銘柄についての詳細

種類	受益権残存口数	上場金融商品取引所又は 登録認可金融商品取引業協会名	内容
	(2020年9月29日現在)		
証券投資信託の受益権	11,520,000口	東京証券取引所	売買単位1口

24. 株式会社SBI証券2022年10月14日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

(1) 発行日

2020年10月13日

(2) 売出価額の総額

300百万円

(3) 対象銘柄の発行会社の名称および住所

野村アセットマネジメント株式会社

東京都中央区日本橋一丁目12番1号

(4) 理由

野村アセットマネジメント株式会社は、NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信（銘柄コード：1570.T）の受益権を表章する受益証券（以下「対象受益証券」という。）の発行会社であり、上記24.に記載の社債は、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ある早期償還判定日（最終償還判定日を除く。）における対象受益証券の終値が早期償還判定水準以上になった場合、元本金額で早期償還され、また、当該社債の要項に規定された条件に従い、計算代理人が算定するところにより、ロックイン事由が発生し、かつ最終償還判定日における対象受益証券の終値が行使価格未満になった場合、対象受益証券口数の交付等により満期償還される。したがって、対象受益証券の情報は、当該社債の投資判断に重要な影響を及ぼすと考えられる。但し、当該社債の発行会社、売出人その他の当該社債の発行に係る関係者は、独自に対象受益証券の情報に関していかなる調査も行っておらず、その正確性及び完全性について何ら保証するものではない。なお、以下に記載した情報は公開の情報より抜粋したものである。

(5) 対象銘柄についての詳細

種類	受益権残存口数	上場金融商品取引所又は 登録認可金融商品取引業協会名	内容
	(2020年9月29日現在)		
証券投資信託の受益権	11,520,000口	東京証券取引所	売買単位1口

2【継続開示会社たる当該会社に関する事項】

1．株式会社SBI証券2020年12月29日満期早期償還条項付/他社株転換条項付 円建社債（三井不動産株式会社）

三井不動産株式会社

(1) 対象銘柄に関して当該会社が提出した書類

有価証券報告書及びその添付書類

第108期

（自 2019年4月1日
至 2020年3月31日）

2020年6月26日 関東財務局長に提出

四半期報告書又は半期報告書

第109期第1四半期

（自 2020年4月1日
至 2020年6月30日）

2020年8月13日 関東財務局長に提出

臨時報告書

の有価証券報告書提出後、金融商品取引法第24条の5第4項及び企業内容等の開示に関する内閣府令第19条第2項第9号の2の規定に基づく臨時報告書を2020年6月30日に関東財務局長に提出。

訂正報告書

該当事項はありません。

(2) 上記書類の写しを縦覧に供している場所

三井不動産株式会社関西支社

（大阪市中央区備後町四丁目1番3号）

株式会社東京証券取引所

（東京都中央区日本橋兜町2番1号）

2．株式会社SBI証券2021年12月6日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債

（NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信）

野村アセットマネジメント株式会社（ファンド名称：NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信）

(1) 対象銘柄に関して当該会社が提出した書類

有価証券報告書及びその添付書類

第8期

（自 2019年5月21日
至 2020年5月20日）

2020年8月17日 関東財務局長に提出

四半期報告書又は半期報告書

該当事項はありません。

臨時報告書

該当事項はありません。

訂正報告書

該当事項はありません。

(2) 上記書類の写しを縦覧に供している場所

株式会社東京証券取引所

（東京都中央区日本橋兜町2番1号）

3．株式会社SBI証券2021年12月10日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債

（NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信）

野村アセットマネジメント株式会社（ファンド名称：NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信）

上記2．を参照のこと。

4．株式会社SBI証券2021年12月17日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債

（NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信）

野村アセットマネジメント株式会社（ファンド名称：NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信）

上記2．を参照のこと。

5. 株式会社SBI証券2021年6月24日満期早期償還条項付/他社株転換条項付 円建社債(株式会社良品計画)
株式会社良品計画

(1) 対象銘柄に関して当該会社が提出した書類

有価証券報告書及びその添付書類

第41期

(自 2019年3月1日
至 2020年2月29日)

2020年5月28日 関東財務局長に提出

四半期報告書又は半期報告書

第42期第1四半期

(自 2020年3月1日
至 2020年5月31日)

2020年7月13日 関東財務局長に提出

臨時報告書

の有価証券報告書提出後、金融商品取引法第24条の5第4項及び企業内容等の開示に関する内閣府令第19条第2項第9号の2の規定に基づく臨時報告書を2020年5月29日に関東財務局長に提出。

訂正報告書

該当事項はありません。

(2) 上記書類の写しを縦覧に供している場所

株式会社東京証券取引所

(東京都中央区日本橋兜町2番1号)

6. 株式会社SBI証券2021年12月23日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

野村アセットマネジメント株式会社(ファンド名称: NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

上記2.を参照のこと。

7. 株式会社SBI証券2022年1月7日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

野村アセットマネジメント株式会社(ファンド名称: NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

上記2.を参照のこと。

8. 株式会社SBI証券2022年1月11日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

野村アセットマネジメント株式会社(ファンド名称: NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

上記2.を参照のこと。

9. 株式会社SBI証券2021年7月15日満期早期償還条項付/他社株転換条項付 円建社債(三菱電機株式会社)
三菱電機株式会社

(1) 対象銘柄に関して当該会社が提出した書類

有価証券報告書及びその添付書類

第149期

(自 2019年4月1日
至 2020年3月31日)

2020年6月26日 関東財務局長に提出

四半期報告書又は半期報告書

第150期第1四半期

(自 2020年4月1日
至 2020年6月30日)

2020年8月12日 関東財務局長に提出

臨時報告書

の有価証券報告書提出後、金融商品取引法第24条の5第4項及び企業内容等の開示に関する内閣府令第19条第2項第9号の2の規定に基づく臨時報告書を2020年6月30日に関東財務局長に提出。

訂正報告書

該当事項はありません。

(2) 上記書類の写しを縦覧に供している場所

株式会社東京証券取引所
(東京都中央区日本橋兜町2番1号)

10. 株式会社SBI証券2022年1月17日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)
野村アセットマネジメント株式会社(ファンド名称:NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)
上記2.を参照のこと。

11. 株式会社SBI証券2022年1月17日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)
野村アセットマネジメント株式会社(ファンド名称:NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)
上記2.を参照のこと。

12. 株式会社SBI証券2022年4月1日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均ダブルインバース・インデックス連動型上場投信)
野村アセットマネジメント株式会社(ファンド名称:NEXT FUNDS 日経平均ダブルインバース・インデックス連動型上場投信)

(1) 対象銘柄に関して当該会社が提出した書類

有価証券報告書及びその添付書類

第6期

(自 2019年5月21日
至 2020年5月20日)

2020年8月17日 関東財務局長に提出

四半期報告書又は半期報告書

該当事項はありません。

臨時報告書

該当事項はありません。

訂正報告書

該当事項はありません。

(2) 上記書類の写しを縦覧に供している場所

株式会社東京証券取引所

(東京都中央区日本橋兜町2番1号)

13. 株式会社SBI証券2020年10月16日満期早期償還条項付/他社株転換条項付 円建社債(三菱地所株式会社)
三菱地所株式会社

(1) 対象銘柄に関して当該会社が提出した書類

有価証券報告書及びその添付書類

第116期

(自 2019年4月1日
至 2020年3月31日)

2020年6月26日 関東財務局長に提出

四半期報告書又は半期報告書

第117期第1四半期

(自 2020年4月1日
至 2020年6月30日)

2020年8月14日 関東財務局長に提出

臨時報告書

の有価証券報告書提出後、金融商品取引法第24条の5第4項及び企業内容等の開示に関する内閣府令第19条第2項第9号の2の規定に基づく臨時報告書を2020年6月30日に関東財務局長に提出。

訂正報告書

該当事項はありません。

(2) 上記書類の写しを縦覧に供している場所

株式会社東京証券取引所
(東京都中央区日本橋兜町2番1号)
株式会社名古屋証券取引所
(名古屋市中区栄三丁目8番20号)
三菱地所株式会社横浜支店
(横浜市西区みなとみらい二丁目2番1号)
三菱地所株式会社中部支店
(名古屋市中区栄二丁目3番1号)
三菱地所株式会社関西支店
(大阪市北区天満橋一丁目8番30号)

14. 株式会社SBI証券2022年6月6日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)
野村アセットマネジメント株式会社(ファンド名称: NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)
上記2. を参照のこと。

15. 株式会社SBI証券2022年6月17日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)
野村アセットマネジメント株式会社(ファンド名称: NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)
上記2. を参照のこと。

16. 株式会社SBI証券2020年12月23日満期早期償還条項付/他社株転換条項付 円建社債(日本電信電話株式会社)
日本電信電話株式会社

(1) 対象銘柄に関して当該会社が提出した書類

有価証券報告書及びその添付書類

第35期

(自 2019年4月1日
至 2020年3月31日) 2020年6月24日 関東財務局長に提出

四半期報告書又は半期報告書

第36期第1四半期

(自 2020年4月1日
至 2020年6月30日) 2020年8月12日 関東財務局長に提出

臨時報告書

該当事項はありません。

訂正報告書

該当事項はありません。

(2) 上記書類の写しを縦覧に供している場所

株式会社東京証券取引所
(東京都中央区日本橋兜町2番1号)

17. 株式会社SBI証券2022年7月15日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)
野村アセットマネジメント株式会社(ファンド名称: NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)
上記2. を参照のこと。

18. 株式会社SBI証券2021年1月15日満期早期償還条項付/他社株転換条項付 円建社債（Zホールディングス株式会社）

Zホールディングス株式会社

(1) 対象銘柄に関して当該会社が提出した書類

有価証券報告書及びその添付書類

第25期

（自 2019年4月1日
至 2020年3月31日） 2020年6月22日 関東財務局長に提出

四半期報告書又は半期報告書

第26期第1四半期

（自 2020年4月1日
至 2020年6月30日） 2020年8月7日 関東財務局長に提出

臨時報告書

の有価証券報告書提出後、金融商品取引法第24条の5第4項及び企業内容等の開示に関する内閣府令第19条第2項第9号の2の規定に基づく臨時報告書を2020年7月1日に関東財務局長に提出。

訂正報告書

該当事項はありません。

(2) 上記書類の写しを縦覧に供している場所

株式会社東京証券取引所

(東京都中央区日本橋兜町2番1号)

19. 株式会社SBI証券2022年8月12日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債

(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

野村アセットマネジメント株式会社（ファンド名称：NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信）

上記2.を参照のこと。

20. 株式会社SBI証券2022年9月2日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債

(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

野村アセットマネジメント株式会社（ファンド名称：NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信）

上記2.を参照のこと。

21. 株式会社SBI証券2021年3月4日満期早期償還条項付/他社株式株価連動 円建社債（任天堂株式会社）

任天堂株式会社

(1) 対象銘柄に関して当該会社が提出した書類

有価証券報告書及びその添付書類

第80期

（自 2019年4月1日
至 2020年3月31日） 2020年6月29日 関東財務局長に提出

四半期報告書又は半期報告書

第81期第1四半期

（自 2020年4月1日
至 2020年6月30日） 2020年8月12日 関東財務局長に提出

臨時報告書

の有価証券報告書提出後、金融商品取引法第24条の5第4項及び企業内容等の開示に関する内閣府令第19条第2項第9号の2の規定に基づく臨時報告書を2020年6月30日に関東財務局長に提出。

訂正報告書

該当事項はありません。

(2) 上記書類の写しを縦覧に供している場所

任天堂株式会社 東京支店

(東京都台東区浅草橋5丁目21番5号)

株式会社東京証券取引所

(東京都中央区日本橋兜町2番1号)

22. 株式会社SBI証券2021年9月3日満期複数株式参照型早期償還条項付/他社株式株価連動 デジタルクーポン
円建社債(TDK株式会社、三菱地所株式会社)

A TDK株式会社

(1) 対象銘柄に関して当該会社が提出した書類

有価証券報告書及びその添付書類

第124期

(自 2019年4月1日
至 2020年3月31日) 2020年6月23日 関東財務局長に提出

四半期報告書又は半期報告書

第125期第1四半期

(自 2020年4月1日
至 2020年6月30日) 2020年8月7日 関東財務局長に提出

臨時報告書

イ. の有価証券報告書提出後、金融商品取引法第24条の5第4項及び企業内容等の開示に関する内閣府令第19条第2項第9号の2の規定に基づく臨時報告書を2020年6月25日に関東財務局長に提出。

ロ. の有価証券報告書提出後、金融商品取引法第24条の5第4項及び企業内容等の開示に関する内閣府令第19条第2項第12号の規定に基づく臨時報告書を2020年8月19日に関東財務局長に提出。

訂正報告書

上記イ.の臨時報告書を訂正するため、臨時報告書の訂正報告書を2020年9月28日に関東財務局長に提出。

(2) 上記書類の写しを縦覧に供している場所

株式会社東京証券取引所

(東京都中央区日本橋兜町2番1号)

B 三菱地所株式会社

上記13.を参照のこと。

23. 株式会社SBI証券2022年9月22日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

野村アセットマネジメント株式会社(ファンド名称: NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

上記2.を参照のこと。

24. 株式会社SBI証券2022年10月14日満期早期償還条項付/上場投信転換条項付 デジタルクーポン円建社債
(NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

野村アセットマネジメント株式会社(ファンド名称: NEXT FUNDS 日経平均レバレッジ・インデックス連動型上場投信)

上記2.を参照のこと。

第3【指数等の情報】

該当事項はありません。

独立監査人の四半期レビュー報告書

2020年11月11日

株式会社 S B I 証券

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

松本 繁彦

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

原田 達

監査人の結論

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、「経理の状況」に掲げられている株式会社 S B I 証券の2020年4月1日から2021年3月31日までの連結会計年度の第2四半期連結会計期間（2020年7月1日から2020年9月30日まで）及び第2四半期連結累計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）に係る四半期連結財務諸表、すなわち、四半期連結貸借対照表、四半期連結損益計算書、四半期連結包括利益計算書、四半期連結キャッシュ・フロー計算書及び注記について四半期レビューを行った。

当監査法人が実施した四半期レビューにおいて、上記の四半期連結財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる四半期連結財務諸表の作成基準に準拠して、株式会社 S B I 証券及び連結子会社の2020年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する第2四半期連結累計期間の経営成績及びキャッシュ・フローの状況を適正に表示していないと信じさせる事項が全ての重要な点において認められなかった。

監査人の結論の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる四半期レビューの基準に準拠して四半期レビューを行った。四半期レビューの基準における当監査法人の責任は、「四半期連結財務諸表の四半期レビューにおける監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社及び連結子会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、結論の表明の基礎となる証拠を入手したと判断している。

四半期連結財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる四半期連結財務諸表の作成基準に準拠して四半期連結財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない四半期連結財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

四半期連結財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき四半期連結財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる四半期連結財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

四半期連結財務諸表の四半期レビューにおける監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した四半期レビューに基づいて、四半期レビュー報告書において独立の立場から四半期連結財務諸表に対する結論を表明することにある。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる四半期レビューの基準に従って、四半期レビューの過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 主として経営者、財務及び会計に関する事項に責任を有する者等に対する質問、分析的手続その他の四半期レビュー手続を実施する。四半期レビュー手続は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して実施される年度の財務諸表の監査に比べて限定された手続である。
- ・ 継続企業の前提に関する事項について、重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められると判断した場合には、入手した証拠に基づき、四半期連結財務諸表において、我が国において一般に公正妥当と認められる四半期連結財務諸表の作成基準に準拠して、適正に表示されていないと信じさせる事項が認められないかどうか結論付ける。また、継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、四半期レビュー報告書において四半期連結財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する四半期連結財務諸表の注記事項が適切でない場合は、四半期連結財務諸表に対して限定付結論又は否定的結論を表明することが求められている。監査人の結論は、四半期レビュー報告書日までに入手した証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 四半期連結財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる四半期連結財務諸表の作成基準に準拠していないと信じさせる事項が認められないかどうかとともに、関連する注記事項を含めた四半期連結財務諸表の表示、構成及び内容、並びに四半期連結財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示していないと信じさせる事項が認められないかどうかを評価する。
- ・ 四半期連結財務諸表に対する結論を表明するために、会社及び連結子会社の財務情報に関する証拠を入手する。監査人は、四半期連結財務諸表の四半期レビューに関する指示、監督及び実施に関して責任がある。監査人は、単独で監査人の結論に対して責任を負う。

監査人は、監査役に対して、計画した四半期レビューの範囲とその実施時期、四半期レビュー上の重要な発見事項について報告を行う。

監査人は、監査役に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

会社及び連結子会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1. 上記は四半期レビュー報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社(四半期報告書提出会社)が別途保管しております。

2. XBR Lデータは四半期レビューの対象には含まれていません。