

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年7月16日提出
【発行者名】	SOMPOアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 小嶋 信弘
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋二丁目2番16号
【事務連絡者氏名】	津田 浩平
【電話番号】	03-5290-3432
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	中国株 AI運用ファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	募集額 1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2021年1月18日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）につきまして、半期報告書の提出に伴い、訂正すべき事項がありましたので、これを訂正するものであります。

2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部_____は訂正部分を示し、<更新後>の記載事項は原届出書の更新後の内容を示します。

なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」は原届出書の更新後の内容を記載しています。

原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」において「1 財務諸表」は「中間財務諸表」を追加し、「2 ファンドの現況」は更新後の内容を記載しています。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<訂正前>

(略)

<ファンドの特色>

(略)

投資対象とする外国投資信託について

投資顧問会社:ユニオン・バンケール・ジェスティヨン・アンスティテュシオネル(フランス)**エスエーエス**

- ・海外より中国本土資産への投資を可能とするRQFII(人民元適格海外機関投資家)制度による投資枠を保有。(なお、ファンドの運用においては主にストックコネクトによる取引を予定していますが、将来の制度変更等によりRQFIIを使用する可能性があります。)
- ・「ユニオン バンケール プリヴェ ユービービー エスエー」の子会社。
- ・「ユニオン バンケール プリヴェ ユービービー エスエー」は、スイスを代表する資産運用会社の一つ。
- ・グループ全体の運用資産総額は、1,372億スイスフラン(15兆5,337億円)(2020年6月末現在)。

副投資顧問会社:UBP インベストメント・マネジメント(上海)リミテッド

- ・「ユニオン バンケール プリヴェ ユービービー エスエー」および、当社経営陣・運用チームメンバーによる共同出資で2015年に設立。
- ・上海に拠点を置く。株式、債券等の運用戦略を提供。
- ・運用資産残高は、135.2億人民元(約2,056億円)(2020年6月末時点)。

<訂正後>

(略)

<ファンドの特色>

(略)

投資対象とする外国投資信託について

投資顧問会社:ユニオン・バンケール・ジェスティヨン・アンスティテュシオネル(フランス)**エスエーエス**

- ・海外より中国本土資産への投資を可能とするRQFII(人民元適格海外機関投資家)制度による投資枠を保有。(なお、ファンドの運用においては主にストックコネクトによる取引を予定していますが、将来の制度変更等によりRQFIIを使用する可能性があります。)
- ・「ユニオン バンケール プリヴェ ユービービー エスエー」の子会社。
- ・「ユニオン バンケール プリヴェ ユービービー エスエー」は、スイスを代表する資産運用会社の一つ。
- ・グループ全体の運用資産総額は、1,474億スイスフラン(17兆2,679億円)(2020年12月末現在)。

副投資顧問会社:UBP インベストメント・マネジメント(上海)リミテッド

- ・「ユニオン バンケール プリヴェ ユービービー エスエー」および、当社経営陣・運用チームメンバーによる共同出資で2015年に設立。
- ・上海に拠点を置く。株式、債券等の運用戦略を提供。
- ・運用資産残高は、117.9億人民元(約1,868億円)(2020年12月末時点)。

（３）【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

（略）

委託会社等の概況

（ ）資本金の額 1,550百万円 （2020年10月末現在）

（略）

（ ）大株主の状況（2020年10月末現在）

（略）

< 訂正後 >

（略）

委託会社等の概況

（ ）資本金の額 1,550百万円 （2021年4月末現在）

（略）

（ ）大株主の状況（2021年4月末現在）

（略）

2【投資方針】

（３）【運用体制】

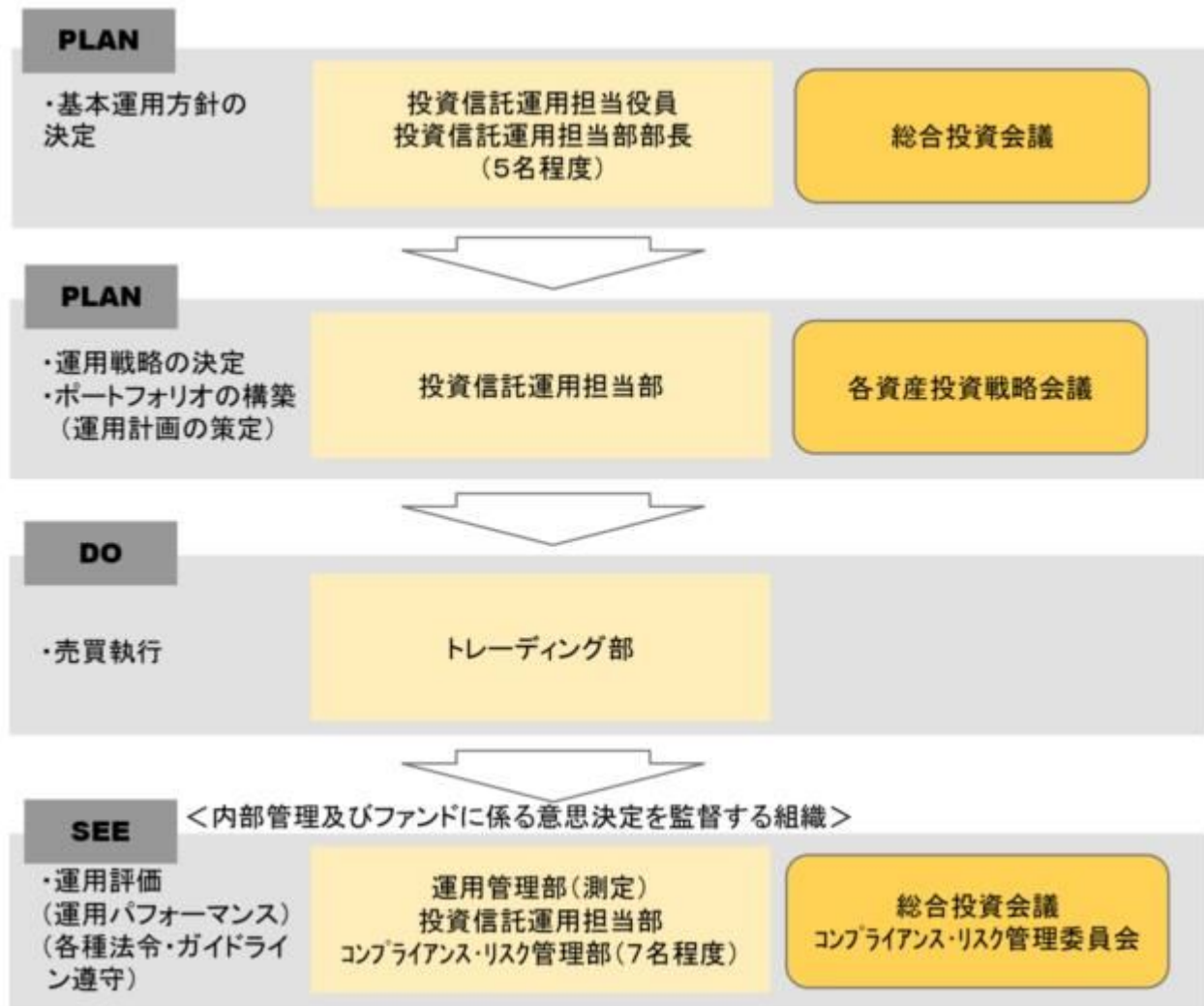
< 訂正前 >

（運用体制）

（略）

各運用担当部で策定された運用計画に基づき、トレーディング部が最良執行の観点から売買を執行します。

（略）



2020年10月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

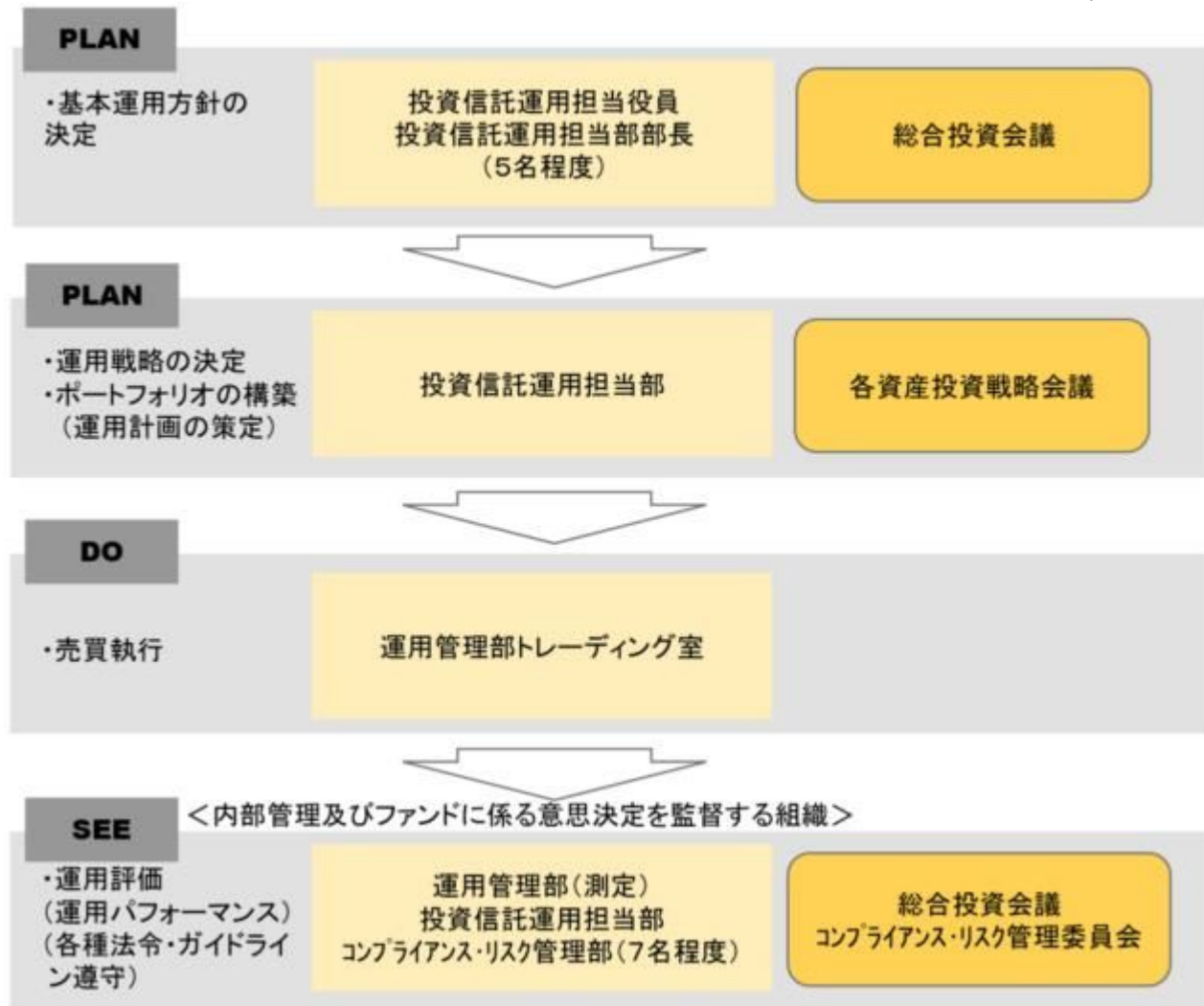
<訂正後>

（運用体制）

（略）

各運用担当部で策定された運用計画に基づき、運用管理部トレーディング室が最良執行の観点から売買を執行します。

（略）



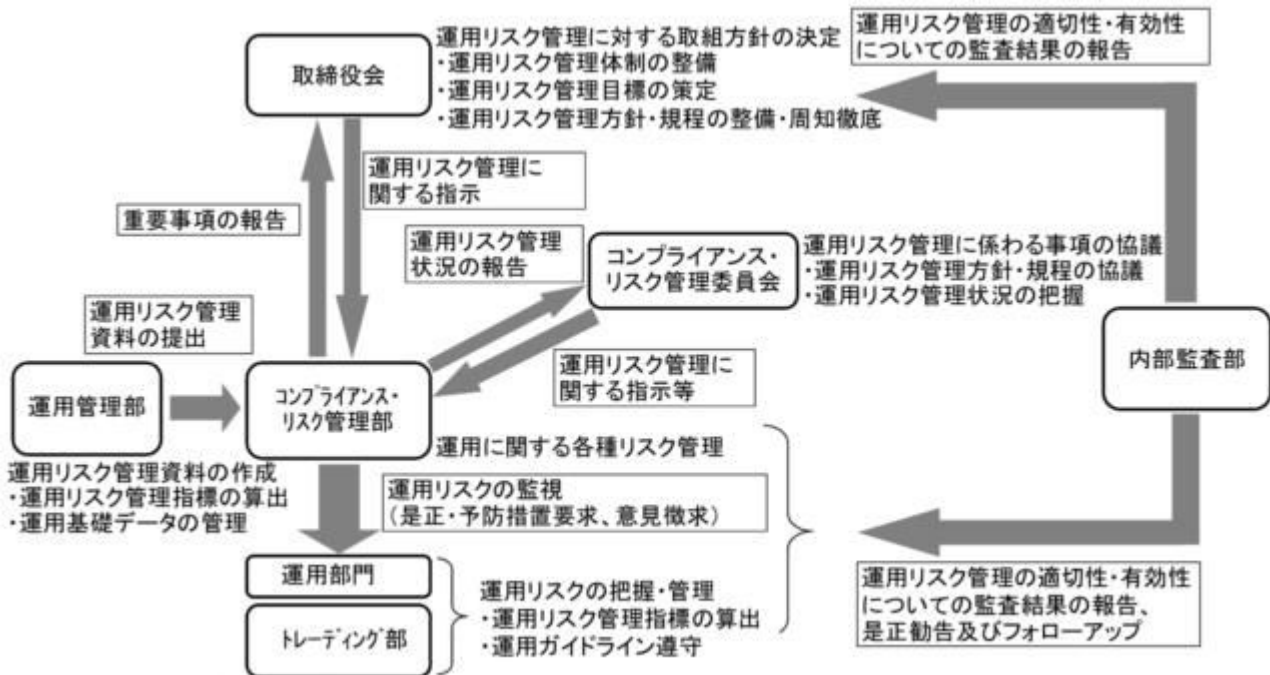
2021年4月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

3【投資リスク】

<訂正前>

(略)

<リスクの管理体制>



※運用リスクには流動性リスクを含みます。

（注）上図は、2020年10月末現在ののものであり、今後変更されることもあります。

ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移

※データは、設定日より掲載しています。



ファンドと他の代表的な資産クラスとの 騰落率の比較

※ファンドと代表的な資産クラスの対象期間が異なりますので、
ご注意ください。



●上記は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額および年間騰落率が記載されており、実際の基準価額および基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

●上記は、期間5年の各月末におけるグラフになります。

●「ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較」は、上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

代表的な資産クラスの指数

日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

東京証券取引所第一部上場全銘柄の基準時(1968年1月4日終値)の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。東証株価指数(TOPIX)は、東京証券取引所の知的財産であり、東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの廃止もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

新興国株:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)

MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに委託会社が独自に計算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)

FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成した株価指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

日本国債:NOMURA-BPI 国債

野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数です。NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

新興国債:J PモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)

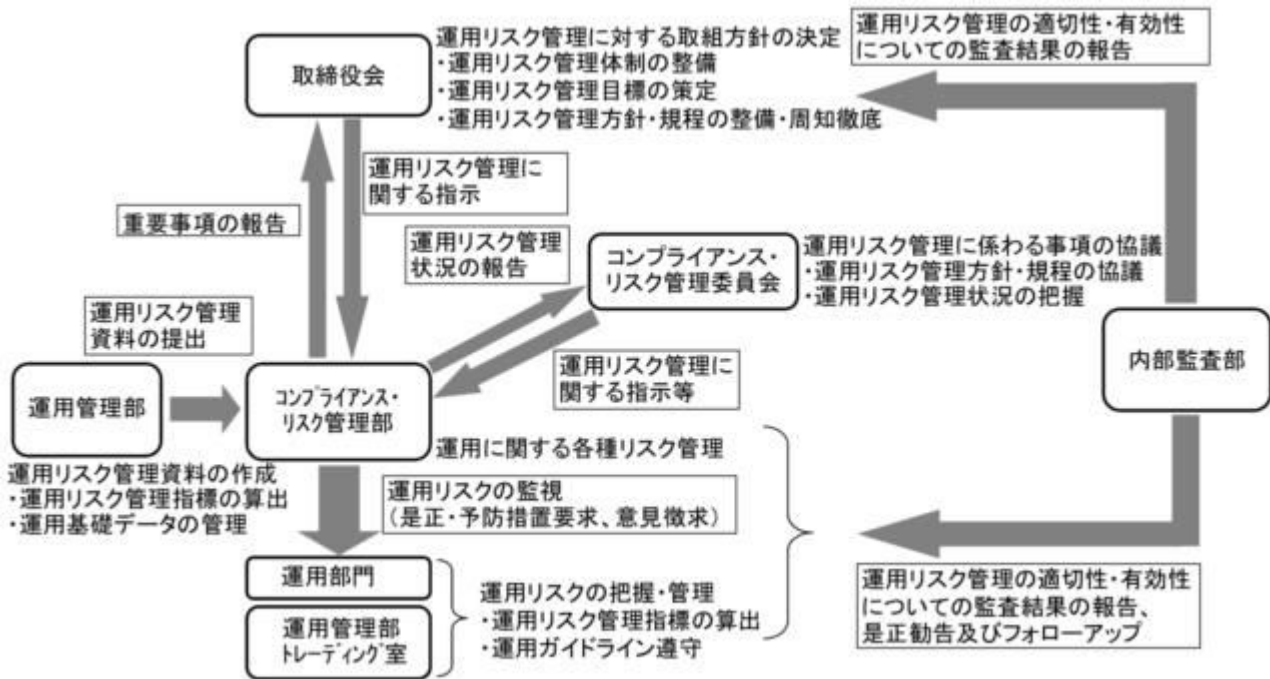
J.P. Morgan Securities LLCが算出し公表している指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。同指数の著作権はJ.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

<訂正後>

(略)

<リスクの管理体制>



※運用リスクには流動性リスクを含みます。

（注）上図は、2021年4月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移

※データは、設定日より掲載しています。



ファンドと他の代表的な資産クラスとの 騰落率の比較

※ファンドと代表的な資産クラスの対象期間が異なりますので、
ご注意ください。



●上記は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額および年間騰落率が記載されており、実際の基準価額および基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

●上記は、期間5年の各月末におけるグラフになります。

●「ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較」は、上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

代表的な資産クラスの指数

日本株: 東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

東京証券取引所第一部上場全銘柄の基準時(1968年1月4日終値)の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。東証株価指数 (TOPIX)は、東京証券取引所の知的財産であり、東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの高標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

新興国株: MSCI エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円換算ベース)

MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。MSCI エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円換算ベース)は、MSCI エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、米ドルベース)をもとに委託会社が独自に計算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

先進国債: FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)

FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

先進国株: MSCI コクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)

MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成した株価指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

日本国債: NOMURA-BPI 国債

野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数です。NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

新興国債: J.P. Morgan Global Emerging Markets Diversified (円ベース)

J.P. Morgan Securities LLCが算出し公表している指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。同指数の著作権はJ.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

(略)

上記は2020年10月末現在のもので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

< 訂正後 >

(略)

上記は2021年4月末現在のもので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

中国株 AI運用ファンド

2021年4月30日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	ルクセンブルク	310,603,784	95.79
親投資信託受益証券	日本	3,167,346	0.98
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		10,486,419	3.23
純資産総額		324,257,549	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、原則として、当該資産の地域別又は発行国籍別の内訳です。

(参考) SOMPOマネープールマザーファンド

2021年4月30日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		422,637,371	100.00
純資産総額		422,637,371	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、原則として、当該資産の地域別又は発行国籍別の内訳です。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

中国株 AI運用ファンド

2021年4月30日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
1	ルクセンブルク	投資信託受益証券	U Access Optimu m China A Equit	18,621.33	14,493.95	269,896,625	16,680	310,603,784	95.79
2	日本	親投資信託受益証券	SOMPOマネープールマザー ファンド	3,174,648	0.9978	3,167,664	0.9977	3,167,346	0.98

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年4月30日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	95.79
親投資信託受益証券	0.98
合計	96.77

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

（参考）SOMPOマネープールマザーファンド

該当事項はありません。

投資有価証券の種類別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

中国株 AI運用ファンド

該当事項はありません。

（参考）SOMPOマネープールマザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

中国株 AI運用ファンド

該当事項はありません。

（参考）SOMPOマネープールマザーファンド

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

中国株 AI運用ファンド

直近日（2021年4月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（円）		1口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間末（2019年10月18日）	801,165,292	808,588,913	1.0792	1.0892
第2計算期間末（2020年10月19日）	401,993,637	405,020,271	1.3282	1.3382
2020年 4月末日	641,409,329		1.0385	
5月末日	585,021,059		1.0174	
6月末日	596,086,323		1.1344	
7月末日	485,246,834		1.2677	
8月末日	487,412,690		1.3600	
9月末日	387,317,997		1.2655	
10月末日	359,364,391		1.3044	
11月末日	300,032,300		1.3310	
12月末日	304,520,753		1.3699	
2021年 1月末日	354,277,231		1.5178	
2月末日	335,927,788		1.5653	
3月末日	331,412,980		1.4942	
4月末日	324,257,549		1.5437	

【分配の推移】

中国株 AI運用ファンド

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0100
第2計算期間	0.0100
第3中間計算期間末	

【収益率の推移】

中国株 AI運用ファンド

	収益率（%）
第1計算期間	8.9
第2計算期間	24.0
第3中間計算期間末	9.4

（注）各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。
 なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

（4）【設定及び解約の実績】

中国株 AI運用ファンド

	設定口数	解約口数
第1計算期間	946,779,294	204,417,115
第2計算期間	127,392,608	567,091,337
第3中間計算期間末	45,357,535	136,857,698

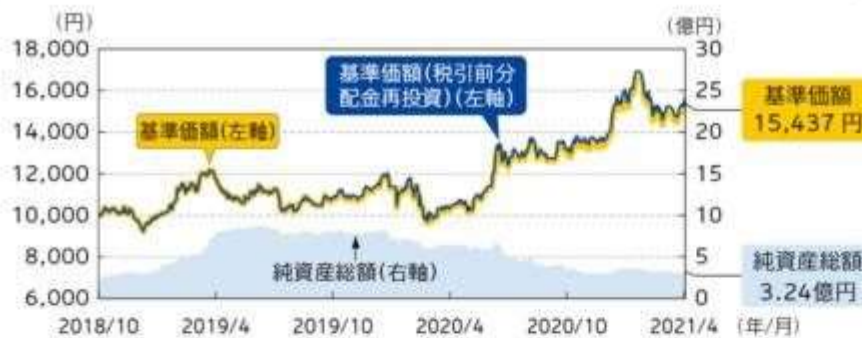
(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

参考情報

基準日:2021年4月30日

● 基準価額・純資産の推移 2018/10/26～2021/04/30



● 分配の推移

2019年10月	100円
2020年10月	100円
-	-
-	-
-	-
設定来累計	200円

● 1万口当たり、税引前

- 基準価額(税引前分配金再投資)は、税引前の分配金を再投資したものとして計算しています。
- 基準価額の計算において信託報酬は控除しています。

● 主要な資産の状況

● 中国株 AI運用ファンド

資産別構成	
資産の種類	純資産比
U ACCESS - OPTIMUM CHINA A EQUITY YC SHARE CLASS	95.79%
SOMPOマネーブルマザーファンド	0.98%
コール・ローン等	3.23%
合計	100.00%

《主要投資対象の投資信託証券の運用状況》

● U Access - Optimum China A Equity YC share class

ユニオン・バンケール・ジェスティオン・アンスティテュシオネル(フランス)エスエーエスおよび
UBP インベストメント・マネジメント(上海)リミテッドが作成したデータを掲載しております。

資産別構成	
資産の種類	純資産比
株式	95.9%
債券	0.0%
現金等	4.1%
合計	100.0%

組入上位10銘柄

	銘柄名	市場	業種	純資産比
1	CHINA MERCHANTS BANK CO LTD -A-	上海	金融	9.1%
2	PING AN BANK CO LTD -A-	深セン	金融	3.4%
3	EVE ENERGY CO LTD	深セン	資本財・サービス	2.4%
4	KWEICHOW MOUTAI CO LTD	上海	生活必需品	2.2%
5	WULIANGYE YIBIN CO LTD -A-	深セン	生活必需品	2.2%
6	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL CO-A-	上海	ヘルスケア	2.2%
7	BANK OF NINGBO -A-	深セン	金融	2.1%
8	SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK -A-	上海	金融	1.9%
9	ASYMCHAM LAB REGISTERED SHS -A-	深セン	ヘルスケア	1.8%
10	HAITIAN FLAVOUR -A-	上海	生活必需品	1.7%
組入銘柄数			159銘柄	

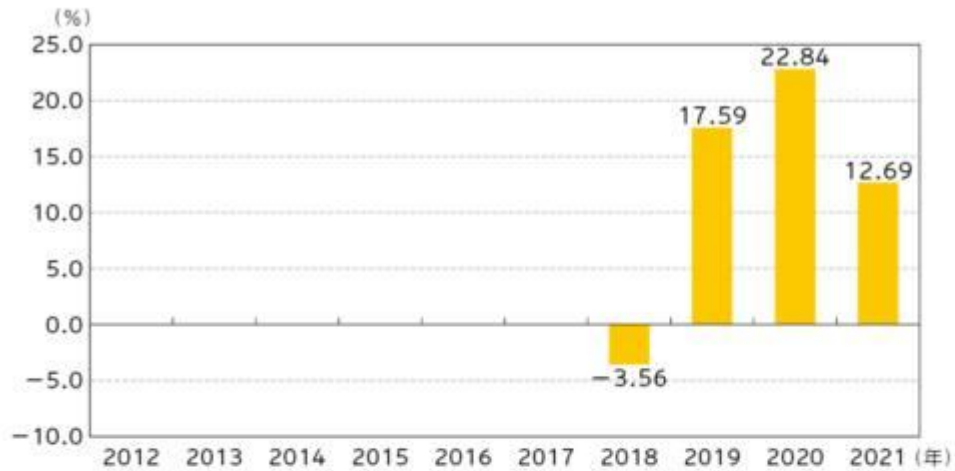
- 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
- 最新の運用状況は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

● SOMPOマネープールマザーファンド

組入上位10銘柄

● 該当事項はありません。

● 年間収益率の推移（暦年ベース）



- ファンドの年間収益率は基準価額(税引前分配金再投資)を使用して計算しています。
- 2018年は設定日(10月26日)から年末、2021年は年初から基準日までの収益率です。
- 当ファンドはベンチマークを設定していません。

- 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
- 最新の運用状況は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）（以下「中間財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）（以下「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、2020年10月20日から2021年4月19日までの中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【中国株 AI 運用ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2020年10月19日現在	第3期中間計算期間末 2021年4月19日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	24,428,841	15,678,988
投資信託受益証券	383,194,144	291,461,057
親投資信託受益証券	3,968,671	3,167,346
流動資産合計	411,591,656	310,307,391
資産合計	411,591,656	310,307,391
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,026,634	-
未払解約金	3,667,913	1,589,625
未払受託者報酬	87,353	54,793
未払委託者報酬	2,766,045	1,734,848
未払利息	58	45
その他未払費用	50,016	31,346
流動負債合計	9,598,019	3,410,657
負債合計	9,598,019	3,410,657
純資産の部		
元本等		
元本	302,663,450	211,163,287
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	99,330,187	95,733,447
元本等合計	401,993,637	306,896,734
純資産合計	401,993,637	306,896,734
負債純資産合計	411,591,656	310,307,391

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期中間計算期間 自 2019年10月19日 至 2020年4月18日	第3期中間計算期間 自 2020年10月20日 至 2021年4月19日
営業収益		
有価証券売買等損益	22,554,357	32,245,588
営業収益合計	22,554,357	32,245,588
営業費用		
支払利息	12,872	8,946

	第2期中間計算期間 自 2019年10月19日 至 2020年4月18日	第3期中間計算期間 自 2020年10月20日 至 2021年4月19日
受託者報酬	121,005	54,793
委託者報酬	3,831,836	1,734,848
その他費用	42,470	31,394
営業費用合計	4,008,183	1,829,981
営業利益又は営業損失()	26,562,540	30,415,607
経常利益又は経常損失()	26,562,540	30,415,607
中間純利益又は中間純損失()	26,562,540	30,415,607
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()	7,142,908	10,544,839
期首剰余金又は期首欠損金()	58,803,113	99,330,187
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,280,644	22,374,323
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,280,644	22,374,323
剰余金減少額又は欠損金増加額	12,807,718	45,841,831
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	12,807,718	45,841,831
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	14,570,591	95,733,447

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき中間計算期間末日の基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
3. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年10月18日を計算期間の末日としておりますが、該日が休業日のため、前計算期間末日を2020年10月19日、当中間計算期間末日を2021年4月19日としております。

(中間貸借対照表に関する注記)

期別	第2期 2020年10月19日現在	第3期中間計算期間末 2021年4月19日現在
1. 受益権の総数	302,663,450口	211,163,287口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3282円 (13,282円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4534円 (14,534円)

(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	第2期 2020年10月19日現在	第3期中間計算期間末 2021年4月19日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>（1）有価証券 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。</p> <p>（2）デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>（3）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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つた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（その他の注記）

項目	第2期	第3期中間計算期間
	自 2019年10月19日 至 2020年10月19日	自 2020年10月20日 至 2021年4月19日
期首元本額	742,362,179円	302,663,450円
期中追加設定元本額	127,392,608円	45,357,535円
期中一部解約元本額	567,091,337円	136,857,698円

（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）

該当事項はありません。

（参考）

中国株 AI運用ファンドの主要投資対象の状況は以下のとおりです。

*なお、以下は参考情報であり、監査証明の対象ではありません。

SOMPOマネープールマザーファンド

貸借対照表

科 目	2020年10月19日現在	2021年4月19日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	168,432,901	414,641,642
流動資産合計	168,432,901	414,641,642
資産合計	168,432,901	414,641,642
負債の部		
流動負債		
未払利息	406	1,192
流動負債合計	406	1,192
負債合計	406	1,192
純資産の部		
元本等		
元本	168,749,862	415,600,020
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	317,367	959,570
元本等合計	168,432,495	414,640,450
純資産合計	168,432,495	414,640,450
負債純資産合計	168,432,901	414,641,642

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

期別	2020年10月19日現在	2021年4月19日現在
1. 受益権の総数	168,749,862口	415,600,020口
2. 元本の欠損	317,367円	959,570円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 0.9981円 (9,981円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 0.9977円 (9,977円)

（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	2020年10月19日現在	2021年4月19日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 該当事項はありません。 (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・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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。	同左

（その他の注記）

項目	自 2019年10月19日 至 2020年10月19日	自 2020年10月20日 至 2021年4月19日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	7,691,861円	168,749,862円
同期中追加設定元本額	169,449,575円	347,983,471円
同期中一部解約元本額	8,391,574円	101,133,313円
元本の内訳*		
中国株 AI運用ファンド	3,976,226円	3,174,648円
東洋・中国A株ファンドDD「華夏」2020	164,773,636円	233,474,109円
東洋・中国A株ファンド「創新」2021（限定追加型）	- 円	178,951,263円
計	168,749,862円	415,600,020円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（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）

該当事項はありません。

U Access Optimum China A Equity YC share class

貸借対照表

2019年12月31日現在

(円)

資産

有価証券ポートフォリオ（時価）	715,698,434
銀行預金	3,081,149
未収利息	8,819
株式発行に係る未収金	54,780,007
資産合計	773,568,409

負債

未払米国財務省証券取引	63,382
未払利息および未払費用	1,957,206
負債合計	2,020,588

純資産合計

771,547,821

(発行済み口数の状況)

2019年1月1日から2019年12月31日まで

(口)

発行済み口数	追加設定口数	解約口数	発行済み口数
2019年1月1日現在			2019年12月31日現在
29,707.360	60,492.130	24,492.680	65,706.810

(直近3年の1口当たりの純資産額)

	2019年12月31日現在	2018年12月31日現在
純資産合計(円)	771,547,821	287,913,420
発行済み口数(口)	65,706.810	29,707.360
1口当たりの純資産額(円)	11,742	9,692

有価証券ポートフォリオ・その他純資産の明細表

(2019年12月31日現在)

数量	銘柄名	通貨	簿価(円)	時価(円)	純資産構成比(%)
公認証券取引所譲渡可能上場有価証券またはその他規制市場で取引される譲渡可能有価証券					
株数			675,887,421	715,698,434	92.76
	中国元		675,887,421	715,698,434	92.76
800	ACCELINK TECNOLOGIES CO LTD -A-	CNY	334,743	370,835	0.05
268,000	AGRICULTURAL BANK OF CHINA -A-	CNY	14,285,175	15,393,134	2.00
4,000	AIER EYE HOSPITAL GRP CO LTD -A-	CNY	2,494,165	2,463,101	0.32
6,500	ALL WINNER TECH SHS -A-	CNY	2,906,624	3,236,633	0.42
8,700	AN HUI WENERGY CO LTD	CNY	672,120	628,352	0.08
1,000	ANGEL YEAST CO LTD -A-	CNY	459,968	477,397	0.06
9,900	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD -A-	CNY	6,282,284	8,444,650	1.09

7,300	ANHUI ZHONGDING SEALING	CNY	956,151	1,028,341	0.13
1,400	AVIC AIRCRAFT -A-	CNY	328,567	356,950	0.05
10,400	AVIC CAPITAL CO LTD	CNY	738,307	785,129	0.10
1,800	AVICOPTER PLC -A-	CNY	1,244,794	1,336,743	0.17
53,800	BANK OF BEIJING -A-	CNY	4,464,742	4,756,598	0.62
184,100	BANK OF CHINA -A-	CNY	10,191,576	10,574,164	1.37
206,900	BANK OF COMMUNICATIONS -A-	CNY	17,782,790	18,131,543	2.35
6,100	BANK OF NANJING CO LTD -A-	CNY	762,638	832,713	0.11
38,300	BAOSHAN IRON AND STEEL -A-	CNY	3,405,420	3,421,973	0.44
5,400	BEIJING CAPITAL DEVELOPMENT CO LTD -A-	CNY	641,728	669,912	0.09
6,600	BEIJING DOUBLE CRANE PHARMACEUTICAL CO L	CNY	1,261,583	1,340,665	0.17
12,100	BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	CNY	1,873,178	2,222,456	0.29
600	BEIJING NEW BUILDING MATERIALS -A-	CNY	180,809	237,687	0.03
5,200	BEIJING ORIENTAL YUHONG WATERPROOF -A-	CNY	1,856,033	2,129,561	0.28
800	BEIJING SHUNXIN AGRICULTURE -A-	CNY	635,470	655,997	0.09
5,800	BEIJING SINNET TECHNOLOGY CO LTD	CNY	1,722,874	1,811,929	0.23
2,900	BEIJING SL PHARMA -A-	CNY	581,635	593,594	0.08
1,920	BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP -A-	CNY	677,570	835,014	0.11
1,800	BEIJING TONGRENTANG -A-	CNY	800,160	789,550	0.10
9,500	BESTV NEW MEDI -A-	CNY	1,378,137	1,384,093	0.18
5,444	BYD COMPANY LTD -A-	CNY	3,672,579	4,039,514	0.52
3,000	CENTENNIAL BRILLIANCE SCIENCE TECHNO -A-	CNY	644,833	650,019	0.08
14,200	CENTRE TESTING -A-	CNY	2,935,495	3,295,580	0.43
21,800	CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	CNY	2,286,732	2,422,817	0.31
22,700	CHANGSHA ZOOMLION HEAVY IND.SCIENCE -A-	CNY	1,944,141	2,360,305	0.31
7,200	CHAOZHOU THREE-CIRCLE (GROUP) CO LTD	CNY	2,303,248	2,496,971	0.32
8,200	CHENGDU XINRONG INVESTMENT CO	CNY	577,463	590,964	0.08
1,000	CHINA AVIC ELECTRO -A-	CNY	215,995	221,654	0.03
60,900	CHINA CONSTRUCTION BANK CORPORATION -A-	CNY	6,626,082	6,853,643	0.89
8,700	CHINA EASTERN AIR -A-	CNY	705,823	786,794	0.10
7,700	CHINA FIBERGLASS CO LTD-SHS.A	CNY	954,023	1,306,421	0.17
3,600	CHINA FILM CO LTD	CNY	741,464	852,870	0.11
12,700	CHINA FORTUNE LAND -A-	CNY	5,594,493	5,673,506	0.74
8,400	CHINA INTL TRAVEL SERVICE -A-	CNY	11,602,568	11,630,305	1.51
3,700	CHINA LIFE INSURANCE SHS -A-	CNY	1,681,451	2,008,258	0.26
3,500	CHINA MEHECO CO -A-	CNY	772,437	710,959	0.09
86,200	CHINA MERCHANTS BANK CO LTD -A-	CNY	46,141,215	50,423,144	6.54
7,800	CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	CNY	705,254	1,002,861	0.13
15,200	CHINA MERCHANTS SECURITIES -A-	CNY	3,932,475	4,327,361	0.56
151,500	CHINA MINSHENG BANKING CORPORATION-A-	CNY	14,227,328	14,880,169	1.93
2,900	CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING -A-	CNY	291,422	290,703	0.04
19,800	CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO -A-	CNY	1,626,661	1,540,994	0.20
19,700	CHINA PACIFIC INSURANCE -A-	CNY	10,880,416	11,603,346	1.50
107,700	CHINA PETROLEUM AND CHEMICAL -A-	CNY	8,430,733	8,566,482	1.11
19,300	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION -A-	CNY	2,865,985	3,046,219	0.39
28,000	CHINA RAILWAY GROUP LTD -A-	CNY	2,581,747	2,588,871	0.34
9,700	CHINA SHIPBUILDING INDUSTRY -A-	CNY	795,528	791,168	0.10
2,200	CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	CNY	576,449	617,768	0.08
14,700	CHINA UNITED TELECOM -A-	CNY	1,390,325	1,347,716	0.17
1,800	CHINA VANKE -A-	CNY	746,479	901,622	0.12
62,000	CHINA YANGTZE POWER -A-	CNY	17,151,090	17,737,936	2.30
1,700	CHONGQING FUZHENG ZHACAI -A-	CNY	578,764	707,316	0.09
6,900	CN SOUTH PUBLIS -A-	CNY	1,353,135	1,282,388	0.17
76,300	CN STATE CEC -A-	CNY	6,427,508	6,674,623	0.87
18,200	COSCO SHIPPING - REGS -A-	CNY	1,404,636	1,492,959	0.19

数量	銘柄名	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	純資産構成比 (%)
40,000	CRRC CORP -A-	CNY	4,565,909	4,445,536	0.58
9,700	DALIAN MERRO PHARMACEUTICAL CO LTD -A-	CNY	558,663	492,215	0.06
30,000	DAQIN RAILWAY CO LTD -A-	CNY	3,561,326	3,833,807	0.50
4,600	DONFANG ELECTRICAL MACHINERY -A-	CNY	632,264	658,020	0.09
9,000	EAST MONEY INFO -A-	CNY	2,025,985	2,209,226	0.29
7,200	EVERBRIGHT SECURITIES -A-	CNY	1,282,102	1,468,147	0.19
5,600	FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES -A-	CNY	2,302,956	2,392,744	0.31
11,400	FINANCIAL STREET HOLDING CO LTD	CNY	1,378,160	1,440,877	0.19
8,300	FJ YAOHUA GLASS -A-	CNY	2,781,478	3,099,376	0.40
20,200	FOUNDER SECURITIES -A-	CNY	2,098,080	2,726,066	0.35
8,300	FUJIAN LONGKING -A-	CNY	1,259,507	1,259,646	0.16
2,900	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD -A-	CNY	1,072,734	1,747,830	0.23
68,100	GD POWER DEVELOPMENT - SHS -A-	CNY	2,725,002	2,480,441	0.32
9,800	GD WEN S FOOD -A-	CNY	5,569,564	5,125,441	0.66
6,600	GEMDALE CORP -A-	CNY	1,266,412	1,489,628	0.19
3,000	GF SECURITIES CO LTD -A-	CNY	640,843	708,390	0.09
3,500	GLODON COMPANY LIMITED	CNY	1,791,118	1,851,217	0.24
11,900	GOLDCARD SMART GROUP CO LTD	CNY	2,623,041	2,824,767	0.37
40,700	GOSUNCN TECHNOLOGY-A-	CNY	3,450,169	3,756,773	0.49
20,600	GREENLAND HLDGS -A-	CNY	2,233,020	2,228,527	0.29

4,100	GUANGDONG HAI GROUP CO LTD -A-	CNY	2,094,436	2,297,483	0.30
11,000	GUANGSHEN RAILWAY -A-	CNY	523,320	523,938	0.07
11,700	GUANGZHOU BAIYUN INTL AIRPORT CO LTD -A-	CNY	3,456,860	3,177,951	0.41
2,600	GUANGZHOU WONFO BIOTECH CO LTD	CNY	1,910,777	2,095,161	0.27
2,000	GUIZHOU SPACE-SHS -A-	CNY	780,261	827,156	0.11
3,600	GUOSEN SECURITIES -A-	CNY	681,073	703,254	0.09
20,359	GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	CNY	5,484,686	5,859,482	0.76
8,800	GUOYUAN SECURITIES -A-	CNY	1,152,480	1,269,779	0.16
3,500	GZ BYS PHARMACE -A-	CNY	1,887,644	1,940,019	0.25
5,900	GZ HAIGE COMMUNICATIONS GRP INC -A-	CNY	879,735	994,595	0.13
13,100	HAIER SMART-A RG REGISTERED SHS -A-	CNY	3,300,547	3,976,233	0.52
2,500	HAITIAN FLAVOUR -A-	CNY	4,169,117	4,183,644	0.54
32,500	HAITONG SEC SHS -A-	CNY	7,043,379	7,820,936	1.01
900	HAN S LASER TECH -A-	CNY	465,358	560,362	0.07
4,900	HANGZHOU KIK-VISION DIGITAL TECH -A-	CNY	2,380,557	2,497,127	0.32
10,700	HANGZHOU SONGCHENG TOURISM	CNY	4,497,869	5,148,120	0.67
10,900	HEILAN HOME CO -A-	CNY	1,409,713	1,303,028	0.17
28,300	HUA XIA BANK CO LTD -A-	CNY	3,562,557	3,378,685	0.44
12,500	HUADIAN POWER INTL	CNY	726,881	714,072	0.09
3,200	HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	CNY	1,650,937	1,750,819	0.23
17,900	HUANENG POWER INTERNATIONAL -A-	CNY	1,742,151	1,554,723	0.20
11,300	HUATAI SECURITIES CO LTD -A-	CNY	3,073,011	3,572,352	0.46
3,900	HUAYU AUTOS SYSTEMS -A-	CNY	1,432,008	1,577,745	0.20
14,300	HUBEI ENERGY GROUP A	CNY	888,923	928,192	0.12
5,500	HUBEI JUMPCAN PHARMA CO LTD-A-	CNY	2,363,553	2,070,069	0.27
212,800	INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA -A-	CNY	18,369,815	19,476,676	2.52
61,900	INDUSTRIAL BANK COMPANY -A-	CNY	17,218,086	19,077,511	2.47
6,900	INDUSTRIAL SECURIT -A-	CNY	689,297	760,411	0.10
33,300	INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD -A-	CNY	812,903	684,202	0.09
5,600	INNER MONGOLIA RARE-EARTH HI-TECH -A-	CNY	886,796	944,894	0.12
23,500	INNER MONGOLIA YI LI INDUSTRY CO LTD -A-	CNY	10,839,666	11,317,592	1.47
1,800	JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	CNY	1,870,710	2,012,819	0.26
9,100	JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD -A-	CNY	10,923,581	12,396,942	1.61
25,900	JIANGSU TRANSPORTATION -A-	CNY	3,239,208	3,293,728	0.43
1,100	JIANGSU YANGHE BREWERY -A-	CNY	1,782,441	1,891,999	0.25
2,600	JIANGSU YUYUE MEDICAL EQUIPMENT SUPPLY	CNY	867,606	822,362	0.11
3,000	JILIN AODONG MEDICINE INDUSTRY -A-	CNY	736,150	771,898	0.10
4,900	JINKE PROPERTY GROUP CO., LTD -A-	CNY	514,894	585,765	0.08
4,300	JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	CNY	873,966	947,089	0.12
1,500	JONJEE HI-TECH -A-	CNY	900,368	918,760	0.12
16,100	JS ZHONG TIAN TECH -A-	CNY	2,113,015	2,080,031	0.27
1,100	KWEICHOW MOUTAI CO LTD -A-	CNY	19,166,334	20,255,516	2.63
5,900	LEPU MEDICAL TECHNOLOGY -A-	CNY	2,661,268	3,037,969	0.39
17,700	LONGSHENG GROUP -A-	CNY	3,640,341	3,986,646	0.52
6,600	LUZHOU OLD CELLAR -A-	CNY	8,477,463	8,904,893	1.15
26,100	METALLURGICAL CORP CHINA -A-	CNY	1,179,458	1,137,534	0.15
17,900	MISHO ECO & LND SHS -A-	CNY	3,013,010	3,087,157	0.40

数量	銘柄名	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	純資産構成比 (%)
8,100	NARI TECHNOLOGY -A-	CNY	2,809,636	2,670,403	0.35
3,700	NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD -A-	CNY	2,959,603	2,830,682	0.37
6,500	NORTHEAST SEC A	CNY	831,534	940,941	0.12
15,400	ORIENT GROUP INCORPORATION	CNY	785,335	805,426	0.10
4,800	ORIENT SECUR CO LTD-A	CNY	743,943	803,932	0.10
47,600	PETROCHINA CO LTD SHS. -A-	CNY	4,169,399	4,319,579	0.56
1,600	PIENTZEHUANG -A-	CNY	2,621,788	2,736,308	0.35
42,000	PING AN INSURANCE GROUP CO. LTD -A-	CNY	56,046,450	55,869,921	7.23
29,500	PING AN INSURANCE GROUP CO. LTD -A-	CNY	6,959,522	7,553,597	0.98
25,200	POLY DEVELOP AND HOLDINGS GRP CO-SHS- A	CNY	5,530,948	6,346,656	0.82
9,100	RISESUM REAL ESTATE DEVELOPMENT SHS A	CNY	1,247,652	1,392,390	0.18
17,100	SAIC MOTOR CO LTD -A-	CNY	6,259,166	6,348,197	0.82
2,800	SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	CNY	1,271,263	1,380,731	0.18
29,100	SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD -A-	CNY	6,425,887	7,722,951	1.00
2,700	SD BUCHANG PH - REGS -A-	CNY	868,120	866,599	0.11
28,500	SDIC POWER HLDG -A-	CNY	3,851,874	4,072,428	0.53
1,300	SF HOLDING CO LTD	CNY	771,312	752,550	0.10
10,100	SH KINGSTAR WIN -A-	CNY	2,417,314	2,355,044	0.31
4,600	SHANDONG GOLD MINING -A-	CNY	2,271,337	2,335,649	0.30
6,400	SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL -A-	CNY	1,544,063	1,979,446	0.26
7,100	SHANDONG JINCHENG PHARMACEUTICAL	CNY	2,147,233	2,193,738	0.28
16,900	SHANGHAI ELECTRIC GROUP -A-	CNY	1,334,694	1,310,032	0.17
5,600	SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD	CNY	643,725	701,697	0.09
3,800	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL CO-A-	CNY	1,469,889	1,573,371	0.20
3,000	SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT -A-	CNY	3,690,621	3,677,373	0.48
10,200	SHANGHAI INTERNATIONAL PORT -A-	CNY	877,652	916,098	0.12
2,658	SHANGHAI JAHWA -A-	CNY	1,381,160	1,280,092	0.17
3,100	SHANGHAI MERCHANICAL&ELECTRICAL INDUS	CNY	733,054	799,558	0.10
4,700	SHANGHAI PHARMACEUTICAL LTD -A-	CNY	1,347,277	1,343,918	0.17

50,800	SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK -A-	CNY	9,175,457	9,781,361	1.27
4,700	SHANGHAI SHI MAO -A-	CNY	305,038	329,212	0.04
7,700	SHANXI SECURITIES -A-	CNY	929,690	993,599	0.13
12,500	SHENERGY CO -A-	CNY	1,099,856	1,130,452	0.15
2,500	SHENGLI TECHNOLOGY -A-	CNY	993,787	814,081	0.11
9,900	SHENWAN HONGY -A-	CNY	733,270	788,989	0.10
9,500	SHENZHEN EVENWIN PRECISION -A-	CNY	2,377,469	2,630,664	0.34
1,600	SHENZHEN HEPALINK PHARMACEUTICAL GROUP C	CNY	409,508	485,896	0.06
6,700	SHENZHEN LUXSHARE PRECISION INDUSTRY -A-	CNY	2,744,351	3,806,568	0.49
20,700	SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO -A-	CNY	2,251,145	2,510,000	0.33
900	SHENZHEN SUNLORD ELECTRONIC -A-	CNY	292,230	323,609	0.04
6,900	SHOOCHOW SECURITIES -A-	CNY	969,874	1,072,952	0.14
4,000	SHZ SALUBRIS PHARMACEUTICALS CO LTD -A-	CNY	1,153,851	1,241,512	0.16
9,600	SIASUN ROBOT AND AUTOMATION CO -A-	CNY	2,047,995	2,092,017	0.27
16,600	SICHUAN CHUANYOU -A-	CNY	2,442,212	2,545,131	0.33
2,000	SICHUAN KELUN -A-	CNY	758,050	731,272	0.09
5,400	SICHUAN NEW HOPE AGRIBUSINESS CO LTD -A-	CNY	1,783,914	1,676,882	0.22
11,400	SINOLINK SECURITIES CO LTD -A-	CNY	1,502,857	1,650,265	0.21
2,200	SPRINGS AIRLINES CO LTD -A-	CNY	1,411,757	1,502,983	0.19
8,700	SUZHOU GOLD MANTIS CONSTRUCTION DECOR -A-	CNY	1,190,840	1,194,411	0.15
5,300	SZ INNOVANCE TECHNOLOGY -A-	CNY	2,109,355	2,527,729	0.33
4,000	TANGSHAN JIDONG -A-	CNY	953,501	1,059,083	0.14
23,000	TBEA CO LTD-A-	CNY	2,349,036	2,380,759	0.31
17,600	TCL CORP -A-	CNY	943,722	1,224,577	0.16
4,500	TIANJIN TASLY PHARMACEUTICAL CO LTD -A-	CNY	1,038,802	1,080,097	0.14
9,700	TONGHUA DONGBAO -A-	CNY	2,429,110	1,909,977	0.25
7,400	TONGWEI CO LTD A	CNY	1,459,880	1,512,385	0.20
400	TOPCHOICE MEDICAL CORPORATION	CNY	563,233	638,376	0.08
3,500	WALVAX BIOTECH -A-	CNY	1,635,855	1,767,318	0.23
20,000	WANGSU SCIENCE -A-	CNY	2,784,073	2,966,803	0.38
3,000	WANHUA POLYURETANE -A-	CNY	2,098,617	2,622,959	0.34
5,600	WEICHAI POWER CO LTD	CNY	978,570	1,384,218	0.18
700	WEIFU HIGH TECHNOLOGY -A-	CNY	209,857	207,567	0.03
11,100	WESTERN MINING-A	CNY	942,616	1,143,791	0.15
8,784	WESTERN SECURITIES CO LTD -A-	CNY	1,207,263	1,339,937	0.17
9,100	WULIANGYE YIBIN CO LTD -A-	CNY	18,264,041	18,840,463	2.44
21,300	XCMG CONSTRUCTION MACHIN -A-	CNY	1,460,211	1,813,564	0.24
3,600	XI AN AERO ENGINE -A-	CNY	1,224,458	1,214,864	0.16

数量	銘柄名	通貨	簿価（円）	時価（円）	純資産構成比（％）
15,000	XIAMEN C & D -A-	CNY	1,967,125	2,099,021	0.27
6,000	XIAMEN ITG GROUP CORP LTD	CNY	654,579	685,509	0.09
1,600	XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH -A-	CNY	305,252	297,614	0.04
15,100	XINXING PIPES -A-	CNY	888,787	980,119	0.13
29,800	YONGHUI SUPERSTORES -A-	CNY	3,901,541	3,497,466	0.45
1,400	YUNDA HOLDING CO., LTD -A-	CNY	642,618	725,668	0.09
500	YUNNAN BAIYAO GROUP -A-	CNY	674,182	696,016	0.09
3,900	ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	CNY	1,385,857	1,626,917	0.21
800	ZHEJIANG SUPOR COOKWARE CO LTD-A-	CNY	902,124	956,101	0.12
6,400	ZHEJIANG WEIXING NEW BUILDING MATERIALS	CNY	1,209,991	1,311,993	0.17
12,800	ZHEJIANG ZHONGDA GROUP CO LTD -A-	CNY	993,097	1,046,008	0.14
3,700	ZHENGZHOU YUTONG COACH -A-	CNY	826,267	820,696	0.11
4,980	ZHONGSHAN PUBLIC UTILITIES GR CO LTD -A-	CNY	626,944	638,738	0.08
300	ZHUHAI GREE ELECTRICAL APPLIANCES INC-A-	CNY	256,290	306,238	0.04
8,200	ZJ JINGSHENG ME SHS -A-	CNY	1,767,330	2,006,468	0.26
5,100	ZJIANG HAILIANG A	CNY	845,258	813,692	0.11
700	ZTE CORPORATION -A-	CNY	365,617	385,607	0.05
	有価証券ポートフォリオ合計		675,887,421	715,698,434	92.76
	銀行預金			3,081,149	0.40
	その他純資産/（負債）			52,768,238	6.84
	合計			771,547,821	100.00

（注1）UBPインベストメンツ株式会社からのデータ提供を受けて作成しております。

（注2）作成時点において、入手可能な直近計算期間の財務諸表を用いております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

中国株 AI運用ファンド

2021年4月30日現在

資産総額	327,520,912円
負債総額	3,263,363円
純資産総額(-)	324,257,549円
発行済数量	210,050,066口
1単位当りの純資産額(/)	1.5437円

(参考) SOMPOマネープールマザーファンド

2021年4月30日現在

資産総額	422,638,586円
負債総額	1,215円
純資産総額(-)	422,637,371円
発行済数量	423,628,486口
1単位当りの純資産額(/)	0.9977円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

<訂正前>

(1) 資本金の額（2020年10月末現在）

（略）

(2) 会社の機構（2020年10月末現在）

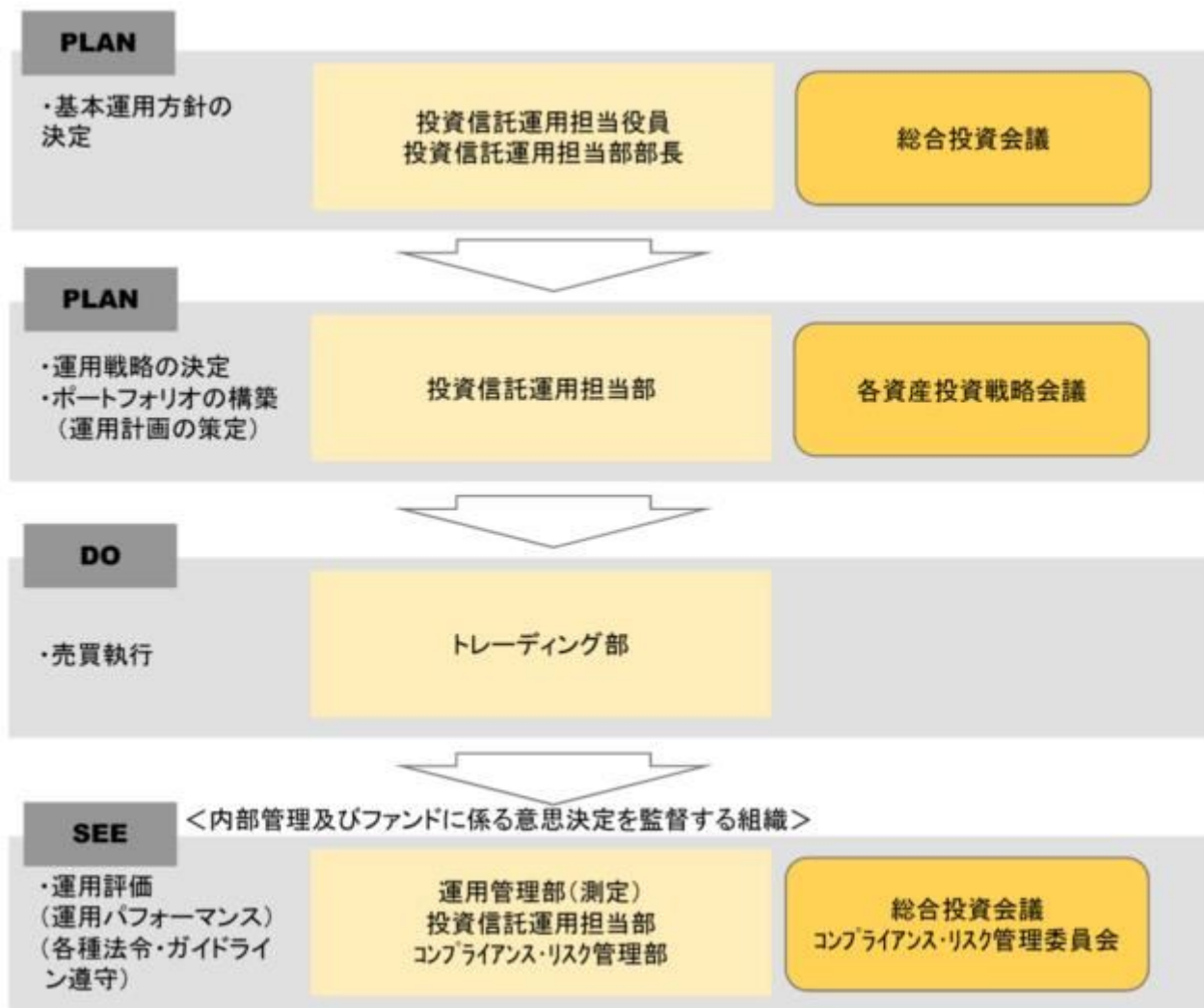
（略）

投資運用の意思決定機構

（略）

- ・各運用担当部で策定された運用計画に基づき、トレーディング部が最良執行の観点から売買を執行します。

（略）



<訂正後>

(1) 資本金の額（2021年4月末現在）

（略）

(2) 会社の機構（2021年4月末現在）

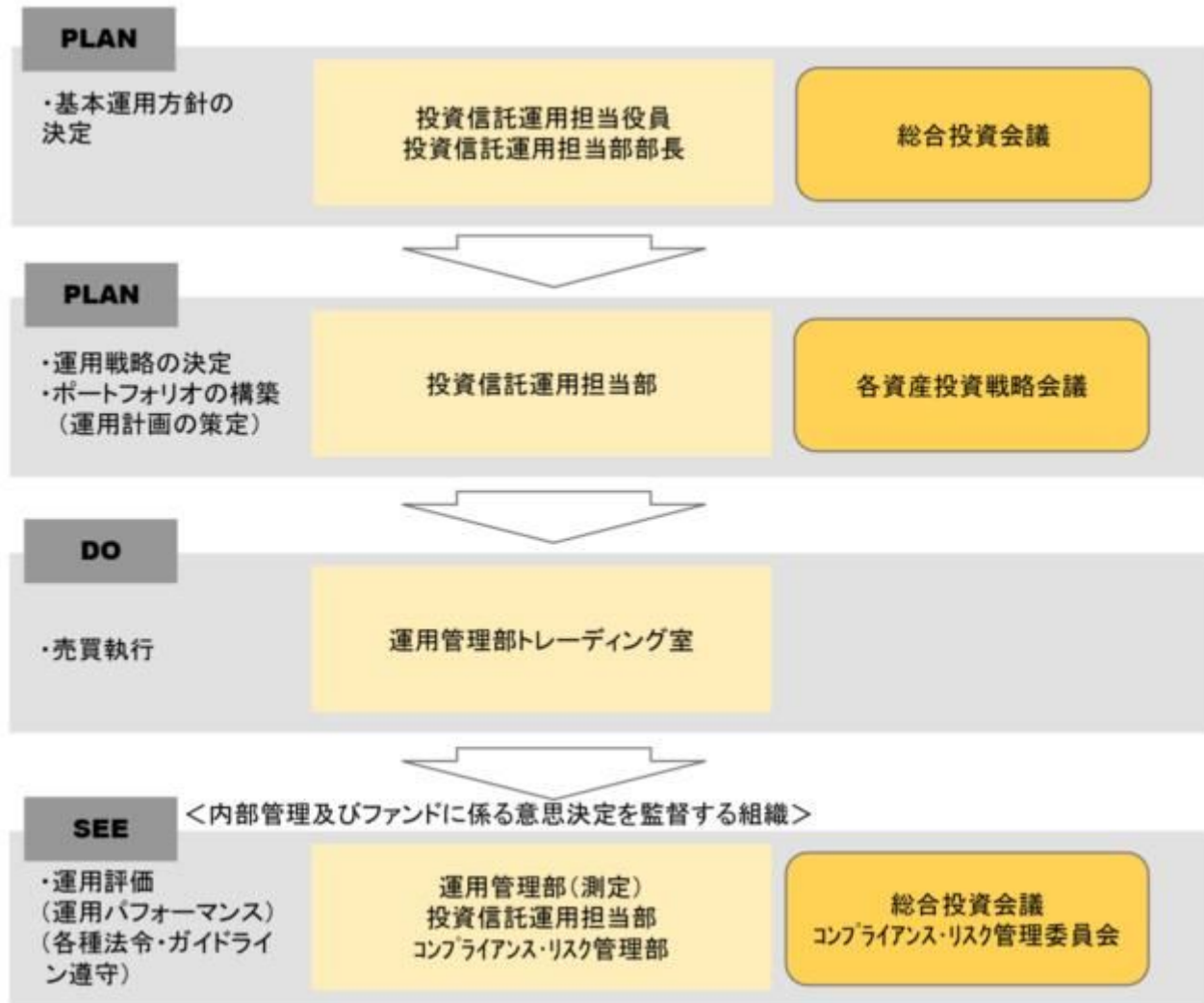
(略)

投資運用の意思決定機構

(略)

- ・各運用担当部で策定された運用計画に基づき、運用管理部トレーディング室が最良執行の観点から売買を執行します。

(略)



2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）ならびに証券投資信託の募集又は私募（第二種金融商品取引業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資一任契約に基づく運用（投資運用業）および投資助言業務を行っています。

委託会社の運用する投資信託（親投資信託を除きます。）は2021年4月末現在、計247本（追加型株式投資信託144本、単位型株式投資信託40本、単位型公社債投資信託63本）であり、その純資産総額の合計は1,683,422百万円です。

3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

1. 委託会社であるSOMPOアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
2. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2020年4月1日から2021年3月31日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

区分	注記 番号	前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
(資産の部)					
流動資産					
1 現金・預金		5,030,360		2,945,148	
2 前払費用		88,889		127,883	
3 未収委託者報酬		1,062,114		1,163,524	
4 未収運用受託報酬		958,520		698,718	
5 未収収益		44		-	
6 その他		1,347		108,949	
流動資産合計		7,141,276		5,044,225	
固定資産					
1 有形固定資産					
(1) 建物	1	19,412		16,555	
(2) 器具備品	1	102,336		113,426	
有形固定資産合計		121,748		129,982	
2 無形固定資産					
(1) 電話加入権		4,535		4,535	
無形固定資産合計		4,535		4,535	
3 投資その他の資産					
(1) 投資有価証券		378,390		371,688	
(2) 長期差入保証金		161,598		173,961	
(3) 繰延税金資産		402,032		368,045	
(4) その他		32		32	
投資その他の資産合計		942,053		913,728	
固定資産合計		1,068,337		1,048,245	
資産合計		8,209,613		6,092,470	

区分	注記 番号	前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
(負債の部)					
流動負債					
1 預り金		6,729		6,525	

2 未払金					
(1) 未払配当金	2	3,000,000		640,000	
(2) 未払手数料		351,384		449,942	
(3) その他未払金		180,135	3,531,520	138,332	1,228,275
3 未払費用			973,410		725,437
4 未払消費税等			47,391		74,945
5 未払法人税等			152,972		259,089
6 賞与引当金			115,230		130,032
7 役員賞与引当金			5,400		6,300
流動負債合計			4,832,655		2,430,606
固定負債					
1 退職給付引当金			150,881		177,918
2 資産除去債務			8,475		9,111
固定負債合計			159,356		187,029
負債合計			4,992,011		2,617,636
(純資産の部)					
株主資本					
1 資本金			1,550,000		1,550,000
2 資本剰余金					
(1) 資本準備金			413,280		413,280
資本剰余金合計			413,280		413,280
3 利益剰余金					
(1) その他利益剰余金					
繰越利益剰余金			1,257,468		1,469,821
利益剰余金合計			1,257,468		1,469,821
株主資本合計			3,220,749		3,433,101
評価・換算差額等					
1 その他有価証券評価差額金			3,147		41,732
評価・換算差額等合計			3,147		41,732
純資産合計			3,217,602		3,474,834
負債・純資産合計			8,209,613		6,092,470

(2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
営業収益					
1 委託者報酬		4,761,002		5,130,232	
2 運用受託報酬		3,408,951	8,169,953	3,361,929	8,492,161
営業費用					
1 支払手数料		2,057,148		2,224,426	
2 広告宣伝費		16,106		14,138	
3 公告費		200		470	
4 調査費		2,381,706		2,203,386	
(1) 調査費		1,067,053		881,821	
(2) 委託調査費		1,311,310		1,318,730	

(3) 図書費		3,342		2,835	
5 営業雑経費		184,920		144,775	
(1) 通信費		6,023		13,988	
(2) 印刷費		163,235		114,745	
(3) 諸会費		15,660	4,640,082	16,041	4,587,196
一般管理費					
1 給料		1,567,354		1,581,885	
(1) 役員報酬		83,506		62,931	
(2) 給料・手当		1,286,043		1,326,451	
(3) 賞与		197,805		192,502	
2 福利厚生費		188,710		199,204	
3 交際費		13,169		4,247	
4 寄付金		300		300	
5 旅費交通費		45,892		2,820	
6 法人事業税		50,010		45,366	
7 租税公課		26,124		31,417	
8 不動産賃借料		211,714		211,971	
9 退職給付費用		67,288		76,373	
10 賞与引当金繰入		115,230		130,032	
11 役員賞与引当金繰入		5,400		6,300	
12 固定資産減価償却費		13,153		26,025	
13 諸経費		349,338	2,653,688	344,942	2,660,886
営業利益			876,182		1,244,078
営業外収益					
1 受取配当金		191		326	
2 受取利息		272		-	
3 有価証券売却益		-		3,436	
4 有価証券償還益		1,358		-	
5 為替差益		-		360	
6 保険配当金		448		567	
7 雑益		1,033	3,305	742	5,432
営業外費用					
1 有価証券売却損		2		-	
2 為替差損		2,620		-	
3 雑損		266	2,889	627	627
経常利益			876,598		1,248,883
特別損失					
1 固定資産除却損	1	409		0	
2 商号変更費用		13,256	13,666	4,975	4,975
税引前当期純利益			862,932		1,243,908
法人税・住民税及び事業税			309,915		375,986
法人税等調整額			29,339		15,569
当期純利益			582,355		852,352

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本	
	資本剰余金	利益剰余金

	資本金	資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	株主資本 合計
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	3,675,113	3,675,113	5,638,393
当期変動額						
剰余金の配当				3,000,000	3,000,000	3,000,000
当期純利益				582,355	582,355	582,355
株主資本以外の 項目の当期 変動額（純 額）						
当期変動額合 計	-	-	-	2,417,644	2,417,644	2,417,644
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	1,257,468	1,257,468	3,220,749

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他有価 証券評価差 額金	評価・換 算差額等 合計	
当期首残高	7,956	7,956	5,646,349
当期変動額			
剰余金の配当			3,000,000
当期純利益			582,355
株主資本以外の 項目の当期 変動額（純 額）	11,103	11,103	11,103
当期変動額合 計	11,103	11,103	2,428,747
当期末残高	3,147	3,147	3,217,602

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本 合計
		資本 準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	1,257,468	1,257,468	3,220,749
当期変動額						
剰余金の配当				640,000	640,000	640,000
当期純利益				852,352	852,352	852,352
株主資本以外の 項目の当期 変動額（純 額）						
当期変動額合 計	-	-	-	212,353	212,353	212,353
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	1,469,821	1,469,821	3,433,101

評価・換算差額等

	その他有価 証券評価差 額金	評価・換 算差額等 合計	純資産合計
当期首残高	3,147	3,147	3,217,602
当期変動額			
剰余金の配当			640,000
当期純利益			852,352
株主資本以外 の項目の当期 変動額（純 額）	44,879	44,879	44,879
当期変動額合 計	44,879	44,879	257,232
当期末残高	41,732	41,732	3,474,834

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

有形固定資産

定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	15年
器具備品	2～20年

3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

4. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、賞与支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。

(2) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、当事業年度における支給見込額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における要支給額を計上しております。

退職給付債務の計算に当たっては、「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号）に定める簡便法によっております。

5. 消費税等の会計処理方法

税抜方式を採用しております。

(未適用の会計基準等)

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日 企業会計基準委員会）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 2020年3月31日 企業会計

基準委員会）

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を認識する。

ステップ2：契約における履行義務を認別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

「収益認識に関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響はありません。

注記事項

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額は、次のとおりであります。

(単位：千円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
建物	91,036	95,327
器具備品	59,912	77,801

2 関係会社項目

関係会社に対する負債は、次のとおりであります。

(単位：千円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
未払金		
未払配当金	3,000,000	640,000

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損の内容は、次のとおりであります。

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
器具備品	409	0

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度 期首株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度 期末株式数
普通株式	24,085株	-株	-株	24,085株

2. 自己株式に関する事項
該当事項はありません。

3. 新株予約権等に関する事項
該当事項はありません。

4. 剰余金の配当に関する事項
(1) 配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額	1株当たり配当額	基準日	効力発生日
2020年3月11日 取締役会	普通株式	3,000,000千円	124,558円	-	2020年3月31日

- (2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの
該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度期末株式数
普通株式	24,085株	-株	-株	24,085株

2. 自己株式に関する事項
該当事項はありません。

3. 新株予約権等に関する事項
該当事項はありません。

4. 剰余金の配当に関する事項
(1) 配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額	1株当たり配当額	基準日	効力発生日
2021年3月30日 取締役会	普通株式	640,000千円	26,572円	-	2021年3月31日

- (2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの
該当事項はありません。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

- (1) 金融商品に対する取組方針

当社では、主として短期的な預金及び一部の有価証券によって運用しており、経営として許容できる範囲内にリスクを制御するよう、適切に資産運用を行っております。

- (2) 金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、そのほとんどが信託財産から支払われるため、回収リスクは僅少であります。

投資有価証券は、主に投資信託を保有しており、今後の基準価額の下落によっては、売却損・評価損計上による利益減少や、評価差額金の減少により純資産が減少するなど、価格変動リスクに晒されております。

- (3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、短期的な預金について、格付の高い金融機関とのみ取引を行っております。

価格変動リスクについては、四半期ごとに時価の状況等を把握し、当該状況については資産運用管理規程に従い、経理担当部が取締役会等へ報告し、適切に管理を行っております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含めておりません（注2.参照）。

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	5,030,360	5,030,360	-
(2) 未収委託者報酬	1,062,114	1,062,114	-
(3) 未収運用受託報酬	958,520	958,520	-
(4) 投資有価証券 其他有価証券	377,640	377,640	-
資産計	7,428,635	7,428,635	-
(1) 未払金	3,531,520	3,531,520	-
(2) 未払費用	973,410	973,410	-
負債計	4,504,931	4,504,931	-

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	2,945,148	2,945,148	-
(2) 未収委託者報酬	1,163,524	1,163,524	-
(3) 未収運用受託報酬	698,718	698,718	-
(4) 投資有価証券 其他有価証券	370,938	370,938	-
資産計	5,178,330	5,178,330	-
(1) 未払金	1,228,275	1,228,275	-
(2) 未払費用	725,437	725,437	-
負債計	1,953,712	1,953,712	-

注1. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券取引に関する事項

資 産

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、及び(3) 未収運用受託報酬

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(4) 投資有価証券

時価については、公表されている基準価額または取引金融機関等から提示された基準価額によっております。

負 債

(1) 未払金及び(2) 未払費用

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

注2. 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

区分	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
非上場株式	750	750

非上場株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、「(4)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

注3. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
(1) 預金	5,030,197	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,062,114	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	958,520	-	-	-
(4) 投資有価証券 其他有価証券のうち 満期があるもの				
株式	-	-	-	-
債券	-	-	-	-
その他	-	157,275	19,415	200,950
合計	7,050,832	157,275	19,415	200,950

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
(1) 預金	2,945,017	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,163,524	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	698,718	-	-	-
(4) 投資有価証券 其他有価証券のうち 満期があるもの				
株式	-	-	-	-
債券	-	-	-	-
その他	-	238,334	19,373	113,231
合計	4,807,260	238,334	19,373	113,231

注4. 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

(有価証券関係)

1. 売買目的有価証券
該当事項はありません。
2. 満期保有目的の債券
該当事項はありません。
3. 子会社株式及び関連会社株式
該当事項はありません。

4. その他有価証券で時価のあるもの

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：千円）

	種類	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	233,779	229,700	4,079
	小計	233,779	229,700	4,079
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	143,861	151,087	7,226
	小計	143,861	151,087	7,226
合計		377,640	380,787	3,147

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：千円）

	種類	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	351,565	290,787	60,777
	小計	351,565	290,787	60,777
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	19,373	20,000	627
	小計	19,373	20,000	627
合計		370,938	310,787	60,150

5. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
(1) 株式	-	-	-
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	97	-	2
合計	97	-	2

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
(1) 株式	-	-	-
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	93,436	3,436	-
合計	93,436	3,436	-

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要（出向受入者に対する出向元への退職金負担額を除く。）

当社は、従業員の退職給付に充てるため、非積立型の確定給付制度及び確定拠出制度を採用しております。

退職一時金制度（非積立型制度であります。）では、退職給付として、給与と勤務期間に基づいた一時金を支給しております。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	134,243	150,881
退職給付費用	27,786	32,311
退職給付の支払額	11,148	5,274
退職給付引当金の期末残高	150,881	177,918

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	150,881	177,918
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	150,881	177,918
退職給付引当金	150,881	177,918
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	150,881	177,918

(3) 退職給付費用

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
簡便法で計算した退職給付費用	27,786	32,311

3. 確定拠出制度

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当社の確定拠出制度への要拠出額	30,681	33,790

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生的主要原因別の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
繰延税金資産		
ソフトウェア損金算入限度超過額	301,391	263,558
退職給付引当金	46,199	54,478
賞与引当金	35,283	39,815
未払事業税	11,335	16,148
繰延資産損金算入限度超過額	4,021	8,210
未払金否認	4,762	5,163
その他	6,059	5,409
繰延税金資産 小計	409,054	392,785
将来減算一時差異等の合計に係る評価性引当額	3,648	2,886
評価性引当額 小計	3,648	2,886
繰延税金資産 合計	405,406	389,899
繰延税金負債		

その他有価証券評価差額金	-	18,418
株式譲渡損益	3,031	3,031
固定資産除去価額	343	405
繰延税金負債 合計	3,374	21,854
繰延税金資産の純額	402,032	368,045

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
法定実効税率 (調整)	30.6%	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.3	
住民税均等割	0.3	
評価性引当額の増減	0.1	
その他	0.2	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	32.5	

(資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

本社事務所及び事業継続用事務所の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を取得から15年と見積り、割引率は0.2%~1.8%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

3. 当該資産除去債務の総額の増減

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
期首残高	8,327	8,475
取得	-	485
時の経過による調整額	147	151
期末残高	8,475	9,111

(セグメント情報等)

セグメント情報

当社は、投資運用事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。

関連情報

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

- (1) 営業収益

(単位：千円)

日本	欧州	米国	中東	アジア	合計
7,171,851	490,694	259,796	192,226	55,384	8,169,953

(注) 営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

- (2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えているため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%を占めるものがないため、記載を省略しております。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

(単位:千円)

日本	欧州	米国	中東	アジア	合計
7,335,140	473,576	379,864	256,439	47,139	8,492,161

(注) 営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えているため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%を占めるものがないため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等に限る。)等
記載すべき重要な取引はありません。

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
該当事項はありません。

(3) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金(千円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
同一の親会社を持つ会社	損保ジャパンDC証券株式会社	東京都新宿区	3,000,000	確定拠出年金業	-	投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託代行手数料の支払(注1)	498,922	未払手数料	115,372
同一の親会社を持つ会社	SOMPOひまわり生命保険株式会社	東京都新宿区	17,250,000	生命保険業	-	投資顧問契約に基づく資産運用	運用受託報酬の受取り(注2)	169,211	未収運用受託報酬	94,179

注1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれて

おります。

注2.取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 代行手数料の支払いについては、一般的取引条件によっております。

(注2) 運用受託報酬の受取りについては、一般的取引条件によっております。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 (千円)	事業 の内容	議決権 等の所有(被所有)割合	関連 当事者との 関係	取引の 内容	取引金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
同一の親会社を持つ会社	損保 ジャパンDC 証券株式会社	東京都新宿区	3,000,000	確定 拠出 年金業	-	投資 信託 に係る 事務代 行の委 託等	投資信託代行手数料の支払(注1)	519,262	未払手数料	134,523
同一の親会社を持つ会社	SOM POひ まわり 生命保 険株式 会社	東京都新宿区	17,250,000	生命 保険業	-	投資 顧問 契約に 基づく 資産 運用	運用受託報酬の受取り(注2)	169,160	未収運用受託報酬	93,872

注1.上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

注2.取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 代行手数料の支払いについては、一般的取引条件によっております。

(注2) 運用受託報酬の受取りについては、一般的取引条件によっております。

(4) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等
役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等との取引はありません。

2.親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1)親会社情報

SOMPOホールディングス株式会社（東京証券取引所に上場）

(2)重要な関連会社の要約財務情報

関連会社はありません。

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額(円)	133,593.60	144,273.79
1株当たり当期純利益金額(円)	24,179.19	35,389.35

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり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いません。

(注) 2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当期純利益(千円)	582,355	852,352
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	582,355	852,352

期中平均株式数(株)	24,085	24,085
------------	--------	--------

5【その他】

<訂正前>

(1) 定款の変更

2020年4月1日付で商号をSOMPOアセットマネジメント株式会社に変更する定款変更を行いました。

2020年6月26日付で監査役の補欠選任に関する条文を削除する定款変更を行いました。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

2020年4月1日付で商号をSOMPOアセットマネジメント株式会社に変更しました。

<訂正後>

(1) 定款の変更

該当事項はありません。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<訂正前>

(1) 受託会社

(略)

資本金の額

324,279百万円(2020年3月末現在)

(略)

<再信託受託会社の概要>

名称 : 日本マスタートラスト信託銀行株式会社

資本金の額 : 10,000百万円(2020年3月末現在)

(略)

(2) 販売会社

(略)

資本金の額は、2020年3月末現在

<訂正後>

(1) 受託会社

(略)

資本金の額

324,279百万円(2021年3月末現在)

(略)

<再信託受託会社の概要>

名称 : 日本マスタートラスト信託銀行株式会社

資本金の額 : 10,000百万円(2021年3月末現在)

(略)

(2)販売会社

(略)

資本金の額は、2021年3月末現在

独立監査人の中間監査報告書

2021年6月18日

SOMPOアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 森 重 俊 寛
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 志 保
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている中国株 AI運用ファンドの2020年10月20日から2021年4月19日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、中国株 AI運用ファンドの2021年4月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年10月20日から2021年4月19日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査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、SOMPOアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間財務諸表を作成し有用な情報を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。

中間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中間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中間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。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、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。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽

表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に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かどうか結論付ける。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、中間監査報告書において中間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中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間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中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

SOMPOアセットマネジメント株式会社及びファンド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、中間監査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、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年6月11日

SOMPOアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 蒲谷剛史
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊藤志保
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているSOMPOアセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第36期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SOMPOアセットマネジメント株式会社の2021年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査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、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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企業会計の基準に準拠して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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき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企業会計の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。

監査役及び監査役会の責任は、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。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、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。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対

応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に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かどうか結論付ける。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、監査報告書において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財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査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。
- ・ 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企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに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るかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、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、監査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、その原本は当社が別途保管しております。

2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。