

平成26年1月21日

各 位

会社名 シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社
(管理会社コード：16714)
代表者名 代表取締役社長 水嶋 浩雅
問合せ先 業務本部 山口 節一
(TEL：03 - 5208-5211)

上場 E T F (管理会社：シンプレクス・アセット・マネジメント) に関する日々の開示事項

シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社を管理会社として上場するETF銘柄について、以下のとおり平成 2 6 年 1 月 2 0 日の状況をご報告します。

上場ETF銘柄(11銘柄)

掲載番号	銘柄名	銘柄コード	上場取引所
1	WTI原油価格連動型上場投信	1671	東証
2	Simple-X NYダウ・ジョーンズ・インデックス上場投信	1679	東証
3	JASDAQ-TOP20上場投信	1551	東証
4	マザーズ・コア上場投信	1563	東証
5	日経カバードコール指数上場投信	1565	東証
6	TOPIXブル2倍上場投信	1568	東証
7	TOPIXベア上場投信	1569	東証
8	中国H株ブル2倍上場投信	1572	東証
9	中国H株ベア上場投信	1573	東証
10	日経平均ブル2倍上場投信	1579	東証
11	日経平均ベア上場投信	1580	東証

* 各銘柄の状況につきましては、次ページ以降をご参照ください。なお、各銘柄名をクリックしていただくと、各銘柄の状況が表示されます。

以 上

会社名 シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社
(管理会社コード : 16714)
代表者名 代表取締役社長 水嶋 浩雅
(銘柄コード : 1671)
問合せ先 業務本部 山口 節一
(TEL : 03 - 5208-5211)

『 W T I 原油価格連動型上場投信 』に関する日々の開示事項

開示基準日:平成26年1月20日

- 1 . 上場 E T F の上場受益権口数
(開示基準日現在)

234,000 口

- 2 . 上場 E T F の純資産総額
(開示基準日現在)

1,457,447,286 円

- 3 . 上場 E T F の一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

6,228 円

- 4 . 上場 E T F の一口あたりの純資産額と対象指標の終値の乖離率
(開示基準日現在)

0.12 %

$$\text{乖離率} = \left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産総額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算した特定の指標の終値}}{\text{円換算した前営業日の特定の指標の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

以 上

会 社 名 シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社
(管理会社コード：16714)
代表者名 代表取締役社長 水嶋 浩雅
(銘柄コード：1679)
問合せ先 業務本部 山口 節一
(TEL：03 - 5208-5211)

『Simple-X NYダウ・ジョーンズ・インデックス上場投信』に関する日々の開示事項

開示基準日:平成26年1月20日

- 1 . 上場 E T F の上場受益権口数
(開示基準日現在)

109,000 口

- 2 . 上場 E T F の純資産総額
(開示基準日現在)

1,793,062,417 円

- 3 . 上場 E T F の一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

16,450 円

- 4 . 上場 E T F の一口あたりの純資産額と対象指標の終値の乖離率
(開示基準日現在)

-0.01 %

$$\text{乖離率} = \left[\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産総額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算した特定の指標の終値}}{\text{円換算した前営業日の特定の指標の終値}} \right] \times 100 (\%)$$

以 上

会 社 名 シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社
(管理会社コード：16714)
代表者名 代表取締役社長 水嶋 浩雅
(銘柄コード：1551)
問合せ先 業務本部 山口 節一
(TEL：03 - 5208-5211)

『 J A S D A Q - T O P 2 0 上場投信 』に関する日々の開示事項

開示基準日:平成26年1月20日

- 1 . 上場 E T F の上場受益権口数
(開示基準日現在)

553,809 口

- 2 . 上場 E T F の純資産総額
(開示基準日現在)

3,332,084,841 円

- 3 . 上場 E T F の一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

6,017 円

- 4 . 上場 E T F の一口あたりの純資産額と対象指標の終値の乖離率
(開示基準日現在)

0.00 %

$$\text{乖離率} = \left[\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right] \times 100 (\%)$$

- 5 . 設定および交換にかかる株式のポートフォリオ (別紙参照)

以 上

JASDAQ-TOP20上場投信

	株価指数終値	日次 騰落率	一口あたりの 純資産額	日次 騰落率	乖離率	受益権総口数	純資産総額
2013/11/14	5,022.70	2.43%	5,044	2.44%	0.00%	553,809	2,793,212,214
2013/11/15	5,062.07	0.78%	5,083	0.77%	-0.01%	553,809	2,814,976,793
2013/11/18	5,155.49	1.85%	5,176	1.83%	-0.02%	553,809	2,866,584,759
2013/11/19	5,202.73	0.92%	5,223	0.91%	-0.01%	553,809	2,892,703,828
2013/11/20	5,186.79	-0.31%	5,207	-0.31%	0.00%	553,809	2,883,838,666
2013/11/21	5,155.94	-0.59%	5,176	-0.60%	0.00%	553,809	2,866,627,927
2013/11/22	5,145.19	-0.21%	5,166	-0.19%	0.02%	553,809	2,860,713,627
2013/11/25	5,030.00	-2.24%	5,050	-2.25%	-0.01%	553,809	2,796,802,714
2013/11/26	5,195.17	3.28%	5,215	3.27%	-0.02%	553,809	2,888,227,778
2013/11/27	5,232.97	0.73%	5,253	0.73%	0.00%	553,809	2,909,120,579
2013/11/28	5,312.07	1.51%	5,332	1.50%	-0.01%	553,809	2,952,886,493
2013/11/29	5,371.39	1.12%	5,391	1.11%	-0.01%	553,809	2,985,692,804
2013/12/02	5,612.31	4.49%	5,632	4.47%	-0.01%	553,809	3,118,982,227
2013/12/03	5,799.67	3.34%	5,783	2.68%	-0.66%	553,809	3,202,703,528
2013/12/04	5,786.04	-0.24%	5,805	0.38%	-0.01%	553,809	3,215,105,798
2013/12/05	5,838.92	0.91%	5,858	0.91%	0.00%	553,809	3,244,339,798
2013/12/06	5,832.17	-0.12%	5,851	-0.12%	0.00%	553,809	3,240,556,454
2013/12/09	5,944.66	1.93%	5,964	1.93%	0.00%	553,809	3,302,714,530
2013/12/10	5,912.14	-0.55%	5,931	-0.55%	-0.01%	553,809	3,284,655,026
2013/12/11	5,692.78	-3.71%	5,712	-3.69%	0.02%	553,809	3,163,131,569
2013/12/12	5,773.16	1.41%	5,792	1.40%	-0.01%	553,809	3,207,596,486
2013/12/13	5,646.81	-2.19%	5,665	-2.19%	0.00%	553,809	3,137,581,393
2013/12/16	5,418.38	-4.05%	5,437	-4.02%	0.02%	553,809	3,010,940,347
2013/12/17	5,536.65	2.18%	5,555	2.17%	-0.01%	553,809	3,076,398,065
2013/12/18	5,540.91	0.08%	5,559	0.07%	0.00%	553,809	3,078,714,180
2013/12/19	5,495.76	-0.81%	5,514	-0.81%	0.01%	553,809	3,053,660,864
2013/12/20	5,422.38	-1.34%	5,440	-1.34%	-0.01%	553,809	3,012,983,531
2013/12/24	5,314.61	-1.99%	5,332	-1.99%	0.00%	553,809	2,953,122,916
2013/12/25	5,443.80	2.43%	5,461	2.42%	-0.01%	553,809	3,024,622,172
2013/12/26	6,032.75	10.82%	6,053	10.84%	0.02%	553,809	3,352,280,042
2013/12/27	6,001.74	-0.51%	6,022	-0.51%	0.00%	553,809	3,335,053,965
2013/12/30	6,131.44	2.16%	6,151	2.14%	-0.02%	553,809	3,406,707,582
2014/01/06	6,100.99	-0.50%	6,120	-0.50%	-0.01%	553,809	3,389,450,564
2014/01/07	5,990.68	-1.81%	6,010	-1.80%	0.01%	553,809	3,328,311,857
2014/01/08	6,109.11	1.98%	6,128	1.96%	-0.01%	553,809	3,393,848,738
2014/01/09	6,209.17	1.64%	6,228	1.63%	-0.01%	553,809	3,449,205,595
2014/01/10	6,149.05	-0.97%	6,168	-0.96%	0.00%	553,809	3,415,849,875
2014/01/14	6,101.65	-0.77%	6,120	-0.78%	-0.01%	553,809	3,389,378,092
2014/01/15	6,048.88	-0.86%	6,067	-0.87%	0.00%	553,809	3,360,097,819
2014/01/16	5,960.95	-1.45%	5,979	-1.45%	0.00%	553,809	3,311,344,711
2014/01/17	6,062.79	1.71%	6,081	1.71%	0.00%	553,809	3,367,686,375
2014/01/20	5,998.80	-1.06%	6,017	-1.05%	0.00%	553,809	3,332,084,841

JASDAQ-TOP20上場投信(交換に係わる交換口数)

※交換申込日(平成26年1月22日)、交換受付日(平成26年1月22日)分の交換口数は以下のとおりです。

交換口数 : 1,965口

JASDAQ-TOP20上場投信(設定ポートフォリオ)

※設定申込日(平成26年1月22日)、設定受付日(平成26年1月22日)分の設定ポートフォリオは以下のとおりです。

	コード	銘柄名	株式数
1	1407	ウエストホールディングス	100
2	2138	クルーズ	100
3	2400	メッセージ	100
4	2461	ファンコミュニケーションズ	100
5	2656	ベクター	100
6	2702	日本マクドナルドホールディングス	100
7	2782	セリア	100
8	3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	10000
9	3858	ユビキタス	100
10	4080	田中化学研究所	100
11	4239	ボラテクノ	200
12	4348	インフォコム	200
13	4755	楽天	100
14	4819	デジタルガレージ	200
15	6769	ザインエレクトロニクス	100
16	6787	メイコー	100
17	6871	日本マイクロニクス	100
18	6890	フェローテック	100
19	7458	第一興商	100
20	9438	エムティーアイ	100

会 社 名 シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社
(管理会社コード：16714)
代表者名 代表取締役社長 水嶋 浩雅
(銘柄コード：1563)
問合せ先 業務本部 山口 節一
(TEL：03 - 5208-5211)

『マザーズ・コア上場投信』に関する日々の開示事項

開示基準日:平成26年1月20日

- 1 . 上場 E T F の上場受益権口数
(開示基準日現在)

874,000 口

- 2 . 上場 E T F の純資産総額
(開示基準日現在)

2,528,541,220 円

- 3 . 上場 E T F の一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

2,893 円

- 4 . 上場 E T F の一口あたりの純資産額と対象指標の終値の乖離率
(開示基準日現在)

-0.01 %

$$\text{乖離率} = \left[\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right] \times 100 (\%)$$

- 5 . 設定および交換にかかる株式のポートフォリオ (別紙参照)

以 上

マザーズ・コア上場投信

日付	株価指数終値	日次 騰落率	一口あたりの 純資産額	日次 騰落率	乖離率	受益権総口数	純資産総額
2013/11/11	1,621.40	-2.90%	1,612	-2.95%	-0.05%	714,565	1,152,153,095
2013/11/12	1,665.44	2.72%	1,656	2.73%	0.01%	714,565	1,183,419,695
2013/11/13	1,695.86	1.83%	1,686	1.81%	-0.01%	714,565	1,205,007,449
2013/11/14	1,697.69	0.11%	1,688	0.12%	0.01%	714,565	1,206,283,555
2013/11/15	1,786.69	5.24%	1,777	5.27%	0.03%	714,565	1,269,491,434
2013/11/18	1,848.08	3.44%	1,838	3.43%	0.00%	714,565	1,313,026,500
2013/11/19	1,877.27	1.58%	1,867	1.58%	0.00%	714,565	1,333,743,565
2013/11/20	1,903.11	1.38%	1,892	1.34%	-0.04%	714,565	1,352,073,202
2013/11/21	1,953.44	2.64%	1,942	2.64%	0.00%	714,565	1,387,805,859
2013/11/22	1,952.41	-0.05%	1,941	-0.05%	0.00%	714,565	1,387,038,375
2013/11/25	2,032.42	4.10%	2,021	4.12%	0.02%	673,396	1,360,620,872
2013/11/26	2,150.80	5.82%	2,138	5.79%	-0.04%	673,396	1,439,856,107
2013/11/27	2,255.62	4.87%	2,242	4.86%	-0.01%	640,457	1,436,155,908
2013/11/28	2,443.09	8.31%	2,429	8.34%	0.03%	640,457	1,555,509,631
2013/11/29	2,543.39	4.11%	2,528	4.08%	-0.03%	640,457	1,619,350,603
2013/12/02	2,705.44	6.37%	2,689	6.37%	0.00%	640,457	1,722,449,620
2013/12/03	2,501.61	-7.53%	2,487	-7.51%	0.02%	640,457	1,592,604,078
2013/12/04	2,537.71	1.44%	2,522	1.41%	-0.04%	607,522	1,532,470,390
2013/12/05	2,625.42	3.46%	2,610	3.49%	0.03%	574,575	1,499,464,608
2013/12/06	2,621.39	-0.15%	2,606	-0.15%	0.00%	574,575	1,497,129,887
2013/12/09	2,909.46	10.99%	2,892	10.97%	-0.01%	574,575	1,661,626,596
2013/12/10	3,010.61	3.48%	2,992	3.46%	-0.02%	574,575	1,719,388,738
2013/12/11	2,813.37	-6.55%	2,796	-6.55%	0.00%	516,919	1,445,460,291
2013/12/12	2,777.09	-1.29%	2,760	-1.29%	0.00%	516,919	1,426,781,114
2013/12/13	2,682.78	-3.40%	2,666	-3.41%	-0.01%	516,919	1,378,272,284
2013/12/16	2,508.32	-6.50%	2,493	-6.49%	0.01%	516,919	1,288,515,284
2013/12/17	2,596.65	3.52%	2,580	3.49%	-0.03%	549,863	1,418,916,399
2013/12/18	2,607.95	0.44%	2,592	0.47%	0.03%	549,863	1,425,067,961
2013/12/19	2,604.29	-0.14%	2,588	-0.15%	-0.01%	549,863	1,423,036,410
2013/12/20	2,573.01	-1.20%	2,557	-1.20%	0.00%	572,927	1,464,880,538
2013/12/24	2,648.02	2.92%	2,631	2.89%	-0.02%	572,927	1,507,499,472
2013/12/25	2,824.12	6.65%	2,806	6.65%	0.00%	572,927	1,607,798,153
2013/12/26	2,838.42	0.51%	2,825	0.68%	0.17%	572,927	1,618,668,688
2013/12/27	2,886.55	1.70%	2,873	1.70%	0.00%	572,927	1,646,058,408
2013/12/30	3,006.52	4.16%	2,992	4.14%	-0.01%	572,927	1,714,305,736
2014/01/06	2,940.55	-2.19%	2,926	-2.21%	-0.01%	572,927	1,676,479,203
2014/01/07	2,883.68	-1.93%	2,870	-1.91%	0.02%	572,927	1,644,140,600
2014/01/08	3,004.93	4.20%	2,990	4.18%	-0.02%	572,927	1,712,987,797
2014/01/09	2,932.73	-2.40%	2,918	-2.41%	-0.01%	572,927	1,671,943,302
2014/01/10	2,890.95	-1.42%	2,877	-1.41%	0.02%	679,877	1,955,814,145
2014/01/14	2,904.39	0.46%	2,890	0.45%	-0.01%	827,933	2,392,679,452
2014/01/15	2,910.37	0.21%	2,896	0.21%	0.00%	827,933	2,397,556,642
2014/01/16	2,939.69	1.01%	2,925	1.00%	-0.01%	874,000	2,556,358,666
2014/01/17	2,925.58	-0.48%	2,911	-0.48%	0.00%	874,000	2,544,064,296
2014/01/20	2,907.87	-0.61%	2,893	-0.62%	-0.01%	874,000	2,528,541,220

マザーズ・コア上場投信(交換に係わる交換口数)

※交換申込日(平成26年1月22日)、交換受付日(平成26年1月22日)分の交換口数は以下のとおりです。

交換口数 : 1,646口

マザーズ・コア上場投信(設定ポートフォリオ)

※設定申込日(平成26年1月22日)、設定受付日(平成26年1月22日)分の設定ポートフォリオは以下のとおりです。

	コード	銘柄名	株式数
1	2121	ミクシィ	100
2	2468	フュートレック	200
3	2492	インフォマート	800
4	3622	ネットイヤーグループ	100
5	3667	enish	100
6	3778	さくらインターネット	100
7	3788	GMOクラウド	1
8	3843	フリービット	400
9	3853	インフォテリア	100
10	4751	サイバーエージェント	100
11	4813	ACCESS	100
12	4974	タカラバイオ	100
13	6255	エヌ・ピー・シー	100
14	7829	サマンサタバサジャパンリミテッド	2
15	9204	スカイマーク	100

会 社 名 シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社
(管理会社コード : 16714)
代表者名 代表取締役社長 水嶋 浩雅
(銘柄コード : 1565)
問合せ先 業務本部 山口 節一
(TEL : 03 - 5208-5211)

『日経カバードコール指数上場投信』に関する日々の開示事項

開示基準日:平成26年1月20日

1. 上場 E T F の上場受益権口数
(開示基準日現在)

30,318 口

2. 上場 E T F の純資産総額
(開示基準日現在)

412,805,135 円

3. 上場 E T F の一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

13,616 円

4. 上場 E T F の一口あたりの純資産額と対象指標の終値の乖離率
(開示基準日現在)

0.08 %

$$\text{乖離率} = \left[\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right] \times 100 (\%)$$

5. 交換にかかる有価証券のポートフォリオ (交換不可)

6. 連動対象指標の特徴と留意点

日経平均カバードコール・インデックス (対象指標) は、日経平均株価 (日経平均) を原資産として、1 ヶ月ごとに新しく期近のコール・オプション (大阪証券取引所オプション市場) を売り建てる「カバードコール戦略」を行った場合の収益を表すようにモデル化されています。具体的には、各限月の取引最終日翌日 (S Q 日) にコール・オプションを清算するとともに、原資産である日経平均より 5 % 高いところの権利行使価格で、新たに直近限月となったコール・オプションを売り、そのプレミアムを理論上再投資した形となっています。

日経平均カバードコール・インデックスについては、以下の H P をご覧ください。

<https://www.simplexasset.com/ip/etf/top/index.html>

対象指標の主な特徴および主な留意点

- ・対象指標は、日経平均がコール・オプションの行使価格を下回る水準で変動する場合には、対象指標も概ね日経平均と同じような変動となりますが、日経平均がコール・オプションの行使価格を上回る水準で変動する場合には、対象指標の変動は日経平均の変動と異なるものとなります。
- ・特に、日経平均がコール・オプションの行使価格を上回る水準にあって更に上昇するような局面においては、対象指標の変動は非常に限定的なものとなるため留意が必要となります。
- ・コール・オプションは、毎月の S Q 日ごとに翌限月に変更となるため、その都度、日経平均の変動に対して対象指標の変動が限定的となる水準が変わります。また、S Q 日ごとのコール・オプションの売却プレミアムも変わります。
- ・日経平均の短期的な上昇に対して、日経平均がコール・オプションの行使価格を上回った場合、対象指標の上昇が限定的なものとなる場合があります。

日経カバードコール指数上場投信

	株価指数終値	日次 騰落率	一口あたりの 純資産額	日次 騰落率	乖離率	受益権総口数	純資産総額
2013/11/07	12,530.05	-0.75%	12,421	-0.70%	0.05%	100,000	1,242,076,185
2013/11/08	12,406.19	-0.99%	12,299	-0.98%	0.01%	100,000	1,229,922,181
2013/11/11	12,550.34	1.16%	12,441	1.15%	-0.01%	100,000	1,244,094,960
2013/11/12	12,761.51	1.68%	12,647	1.66%	-0.03%	100,000	1,264,747,921
2013/11/13	12,720.38	-0.32%	12,606	-0.32%	0.00%	100,000	1,260,640,544
2013/11/14	12,892.13	1.35%	12,773	1.32%	-0.03%	100,000	1,277,331,635
2013/11/15	12,984.53	0.72%	12,863	0.70%	-0.01%	100,000	1,286,346,855
2013/11/18	12,983.10	-0.01%	12,863	0.00%	0.01%	100,000	1,286,279,873
2013/11/19	12,989.52	0.05%	12,870	0.05%	0.00%	100,000	1,287,000,347
2013/11/20	12,962.57	-0.21%	12,843	-0.21%	0.00%	100,000	1,284,254,400
2013/11/21	13,037.30	0.58%	12,915	0.56%	-0.02%	100,000	1,291,536,252
2013/11/22	13,064.81	0.21%	12,942	0.21%	0.00%	100,000	1,294,226,401
2013/11/25	13,168.62	0.79%	13,044	0.79%	-0.01%	100,000	1,304,434,269
2013/11/26	13,156.34	-0.09%	13,032	-0.09%	0.00%	100,000	1,303,173,593
2013/11/27	13,160.22	0.03%	13,034	0.02%	-0.01%	100,000	1,303,398,537
2013/11/28	13,224.31	0.49%	13,097	0.48%	0.00%	100,000	1,309,689,678
2013/11/29	13,166.62	-0.44%	13,042	-0.42%	0.02%	100,000	1,304,219,716
2013/12/02	13,187.13	0.16%	13,064	0.17%	0.01%	100,000	1,306,380,096
2013/12/03	13,248.66	0.47%	13,124	0.46%	-0.01%	100,000	1,312,423,600
2013/12/04	13,180.83	-0.51%	13,055	-0.53%	-0.01%	100,000	1,305,467,993
2013/12/05	13,136.22	-0.34%	13,011	-0.34%	0.00%	100,000	1,301,101,317
2013/12/06	13,164.84	0.22%	13,042	0.24%	0.02%	100,000	1,304,173,695
2013/12/09	13,249.14	0.64%	13,123	0.62%	-0.02%	100,000	1,312,276,477
2013/12/10	13,263.37	0.11%	13,136	0.10%	-0.01%	100,000	1,313,615,473
2013/12/11	13,249.00	-0.11%	13,120	-0.12%	-0.01%	100,000	1,311,983,248
2013/12/12	13,224.03	-0.19%	13,095	-0.19%	0.00%	100,000	1,309,484,449
2013/12/13	13,348.80	0.94%	13,216	0.92%	-0.02%	100,000	1,321,594,091
2013/12/16	13,195.37	-1.15%	13,067	-1.13%	0.02%	100,000	1,306,669,223
2013/12/17	13,292.33	0.73%	13,161	0.72%	-0.02%	100,000	1,316,055,311
2013/12/18	13,510.53	1.64%	13,372	1.60%	-0.04%	100,000	1,337,202,246
2013/12/19	13,743.84	1.73%	13,598	1.69%	-0.04%	100,000	1,359,834,437
2013/12/20	13,758.03	0.10%	13,612	0.10%	0.00%	100,000	1,361,172,633
2013/12/24	13,761.45	0.02%	13,612	0.00%	-0.02%	100,000	1,361,201,929
2013/12/25	13,810.19	0.35%	13,658	0.34%	-0.02%	100,000	1,365,758,903
2013/12/26	13,888.52	0.57%	13,743	0.62%	0.06%	100,000	1,374,277,403
2013/12/27	13,936.25	0.34%	13,788	0.33%	-0.02%	100,000	1,378,834,165
2013/12/30	13,999.63	0.45%	13,851	0.46%	0.00%	100,000	1,385,076,225
2014/01/06	13,857.39	-1.02%	13,706	-1.05%	-0.03%	30,318	415,547,515
2014/01/07	13,814.91	-0.31%	13,666	-0.29%	0.01%	30,318	414,311,695
2014/01/08	14,030.41	1.56%	13,873	1.51%	-0.05%	30,318	420,612,478
2014/01/09	13,891.06	-0.99%	13,749	-0.89%	0.10%	30,318	416,842,159
2014/01/10	13,934.61	0.31%	13,775	0.19%	-0.12%	30,318	417,626,991
2014/01/14	13,555.85	-2.72%	13,396	-2.75%	-0.03%	30,318	406,154,081
2014/01/15	13,852.34	2.19%	13,662	1.99%	-0.20%	30,318	414,206,004
2014/01/16	13,811.32	-0.30%	13,623	-0.29%	0.01%	30,318	413,012,885
2014/01/17	13,813.31	0.01%	13,661	0.28%	0.26%	30,318	414,175,875
2014/01/20	13,756.20	-0.41%	13,616	-0.33%	0.08%	30,318	412,805,135

日経カバードコール指数上場投信(交換に係わる交換口数)

※交換申込日(平成26年1月21日)、交換受付日(平成26年1月21日)分の交換はできません

日経カバードコール指数上場投信(デリバティブ取引)

開示基準日における日経225先物取引の買建玉 14年03月限	26 単位
-----------------------------------	-------

開示基準日における日経225オプション取引のコールオプション売建玉 14年02月限 行使価格	26 単位 16,750 円
--	-------------------

お知らせ

※「日経カバードコール指数上場投信の運用の変更に関するお知らせ」を以下のHPIに掲載しました。

<https://www.simplexasset.com/jp/etf/top/index.html>

「日経カバードコール指数上場投信の運用の変更に関するお知らせ」の主な内容

対象指標への連動を目的とし、基準価額の変動率を対象指標の変動率に一致させることを目指すこととして、平成26年1月10日以降、指標連動有価証券への投資に代わって、株価指数先物取引やオプション取引といったデリバティブ取引を一時的に利用することとします。

以 上

会 社 名 シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社
(管理会社コード : 16714)
代表者名 代表取締役社長 水嶋 浩雅
(銘柄コード : 1568)
問合せ先 業務本部 山口 節一
(TEL : 03 - 5208-5211)

『 T O P I X ブル 2 倍 上場 投信 』 に関する 日々 の 開示 事項

開示基準日:平成26年1月20日

- 1 . 上場 E T F の 上場 受益 権口数
(開示基準日現在)

1,470,000 口

- 2 . 上場 E T F の 純資産 総額
(開示基準日現在)

33,197,756,037 円

- 3 . 上場 E T F の 一口あたり の 純資産 額
(開示基準日現在)

22,584 円

- 4 . 上場 E T F の 一口あたり の 純資産 額 と 対象 指標 の 終値 の 乖離 率
(開示基準日現在)

0.31 %

$$\text{乖離率} = \left[\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right] \times 100 (\%)$$

5 . 連動 対象 指標 の 特徴 と 留意 点

T O P I X レバレッジ (2 倍) 指数 (対象 指標) は、下記の 計算 式 を 用いて 原 指標 である T O P I X (配当 なし) の 前日 比 変動 率 (%) * に対して 2 倍 を 乗じた 変動 率 となる よう に 計算 された 指数 です。

* 前日 比 変動 率 (%) は、小数 第 3 位 四捨五入

当日 の 指数 値 = 前日 の 指数 値 × (1 + 2 倍 × T O P I X (配当 なし) の 前日 比 変動 率)

T O P I X レバレッジ (2 倍) 指数 について は、以下の H P を ご覧ください。

<https://www.simplexasset.com/ip/etf/top/index.html>

対象 指標 となる レバレッジ 型 指標 の 主な 特徴 および 主な 留意 点

・ T O P I X レバレッジ (2 倍) 指数 は、変動 率 が T O P I X (配当 なし) (以下、「T O P I X」といいます。) の 日々 の 変動 率 の 2 倍 となる よう に 算出 されて いる ため、前 営業 日 と 比較 すると その 変動 率 は T O P I X の 2 倍 となります が、2 営業 日 以上 離れた 期間 での 比較 においては、複利 効果 により、T O P I X の 変動 率 の 2 倍 以上 又は 未 満 となる 場合 があります。

・ T O P I X レバレッジ (2 倍) 指数 は、T O P I X が 上昇 局面 においては、より 大きな リターン を 狙う ことが 可能 ですが、下落 局面 においては、T O P I X より 大きく 下落 する 傾向 があります。また、T O P I X が 上昇 ・ 下落 を 相互 に 繰り返す 場合、上記 の 複利 効果 により T O P I X レバレッジ (2 倍) 指数 は 逡減 して いく という 特性 があり、このような 場合、投資 者は 利益 を 得にくく なる ため 留意 が必要です。また、中 長期 に わたって 投資 を する 場合、原 指標 の 変動 率 と レバレッジ 型 指標 の 変動 率 の 乖離 が 大きく なる 可能性 があり、留意 が必要です。

TOPIXブル2倍上場投信

開示基準日におけるTOPIX先物取引の買建玉
14年03月限

5,108 単位

開示基準日における追加申込
開示基準日における換金(解約)請求

0 口

0 口

会 社 名 シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社
(管理会社コード : 16714)
代表者名 代表取締役社長 水嶋 浩雅
(銘柄コード : 1569)
問合せ先 業務本部 山口 節一
(TEL : 03 - 5208-5211)

『 T O P I X ベア上場投信 』に関する日々の開示事項

開示基準日:平成26年1月20日

- 1 . 上場 E T F の上場受益権口数
(開示基準日現在)

1,096,000 口

- 2 . 上場 E T F の純資産総額
(開示基準日現在)

6,205,453,779 円

- 3 . 上場 E T F の一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

5,662 円

- 4 . 上場 E T F の一口あたりの純資産額と対象指標の終値の乖離率
(開示基準日現在)

-0.16 %

$$\text{乖離率} = \left[\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right] \times 100 (\%)$$

5 . 連動対象指標の特徴と留意点

T O P I X インバース (- 1 倍) 指数 (対象指標) は、下記の計算式を用いて原指標である T O P I X (配当なし) の前日比変動率 (%) * に対して - 1 倍を乗じた変動率となるように計算された指数です。

* 前日比変動率 (%) は、小数第 3 位四捨五入

当日の指数値 = 前日の指数値 × (1 - 1 倍 × T O P I X (配当なし) の前日比変動率)

T O P I X インバース (- 1 倍) 指数については、以下の H P をご覧ください。

<https://www.simplexasset.com/ip/etf/top/index.html>

対象指標となるレバレッジ型指標の主な特徴および主な留意点

・ T O P I X インバース (- 1 倍) 指数は、変動率が T O P I X (配当なし) (以下、「 T O P I X 」といいます。) の日々の変動率の - 1 倍となるように算出されているため、前営業日と比較するとその変動率は T O P I X の - 1 倍となりますが、2 営業日以上離れた期間での比較においては、複利効果により、 T O P I X の変動率の - 1 倍以上又は未滿となる場合があります。

・ T O P I X インバース (- 1 倍) 指数は、下落局面でもリターンを狙うことが可能ですが、上昇局面においては、 T O P I X の動きと逆に下落していく傾向があります。また、 T O P I X が上昇・下落を相互に繰り返す場合、上記の複利効果により T O P I X インバース (- 1 倍) 指数は逓減していくという特性があり、このような場合、投資者は利益を得にくくなりますので留意が必要です。また、インバース型指標は、中長期にわたって投資をする場合、原指標の変動率とインバース型指標の変動率の乖離が大きくなる可能性があり、留意が必要です。

TOPIXベア上場投信

開示基準日におけるTOPIX先物取引の売建玉
14年03月限

480 単位

開示基準日における追加申込
開示基準日における換金(解約)請求

0 口

0 口

会 社 名 シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社
(管理会社コード：16714)
代表者名 代表取締役社長 水嶋 浩雅
(銘柄コード：1572)
問合せ先 業務本部 山口 節一
(TEL：03 - 5208-5211)

『中国H株ブル2倍上場投信』に関する日々の開示事項

開示基準日:平成26年1月20日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

40,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

433,189,278 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

10,830 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指標の終値の乖離率
(開示基準日現在)

0.19 %

$$\text{乖離率} = \left(\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産総額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算した特定の指標の終値}}{\text{円換算した前営業日の特定の指標の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

5. 連動対象指標の特徴と留意点

ハンセン中国企業株レバレッジ指数は、ハンセン中国企業株指数の前日比変動率を2倍した指数です。ハンセン中国企業株指数の2倍のレバレッジの効いたリターンに加え、株式投資に対する借入金利及びリバランスに伴う印紙税も指数に反映されます。

ハンセン中国企業株レバレッジ指数については、以下のHPをご覧ください。

<https://www.simplexasset.com/jp/etf/top/index.html>

対象指標となるレバレッジ型指標の主な特徴および主な留意点

注：ハンセン中国企業株レバレッジ指数は、ハンセン中国企業株指数（以下、「原指数」といいます。）の2倍のレバレッジの効いたリターンに加え、株式投資に対する借入金利及びリバランスに伴う印紙税も指数に反映されるため、正確に2倍として計算されるわけではありません。ただし、以下では説明の簡略化のために、「2倍」としていることにご注意ください。

・ ハンセン中国企業株レバレッジ指数は、変動率が原指数の日々の変動率の2倍となるように算出されているため、前営業日と比較するとその変動率は原指数の2倍となりますが、2営業日以上離れた期間での比較においては、複利効果により、原指数の変動率の2倍以上又は未滿となる場合があります。

・ ハンセン中国企業株レバレッジ指数は、原指数が上昇トレンドにある場合において、収益をさらに強く求める指標であるため、原指数の上昇を見込む場合には有効です。また、下落局面においては、原指数より大きく下落する傾向があります。

・ レバレッジ型指標は、中長期にわたって投資をする場合、原指数の変動率とレバレッジ型指標の変動率の乖離が大きくなる可能性があり、留意が必要です。

・ 原指数の上昇と下落が相互に繰り返されるような相場においては、複利効果により、原指標と比較して指数のパフォーマンスが逓減して行くという特性があり、投資者は利益を得にくくなりますので、留意が必要です。

・ 円換算した原指標の動きと、円換算したレバレッジ型指標の動きには、為替変動の影響もあるので、留意が必要です。

中国H株ブル2倍上場投信

開示基準日におけるHang Seng China Enterprises Index Future取引の買建玉
(開示基準日における取引を含む。)

14年01月限

126 単位

	A	B
開示基準日までの追加申込	0 口	0 口
開示基準日までの換金(解約)請求	0 口	0 口

A：開示基準日の前営業日

B：開示基準日

会 社 名 シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社
(管理会社コード : 16714)
代表者名 代表取締役社長 水嶋 浩雅
(銘柄コード : 1573)
問合せ先 業務本部 山口 節一
(TEL : 03 - 5208-5211)

『中国H株ベア上場投信』に関する日々の開示事項

開示基準日:平成26年1月20日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

50,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

618,820,202 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

12,376 円

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額と対象指標の終値の乖離率
(開示基準日現在)

-0.09 %

$$\text{乖離率} = \left[\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産総額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{円換算した特定の指標の終値}}{\text{円換算した前営業日の特定の指標の終値}} \right] \times 100 (\%)$$

5. 連動対象指標の特徴と留意点

ハンセン中国企業株ショート指数は、ハンセン中国企業株指数（配当込）の前日比変動率をインバース（- 1 倍）した指数です。ハンセン中国企業株ショート指数は、ハンセン中国企業株指数（配当込）の前日比変動率の - 1 倍のリターンを示します。ハンセン中国企業株指数（配当込）の - 1 倍のリターンに加え、貸出金利とリバランスに伴う印紙税及び信用売りをしている株が支払いうる配当金も反映します。

ハンセン中国企業株ショート指数については、以下のHPをご覧ください。

<https://www.simplexasset.com/jp/etf/top/index.html>

対象指標となるインバース型指標の主な特徴および主な留意点

注：ハンセン中国企業株ショート指数は、ハンセン中国企業株指数（配当込）（以下、「原指数」といいます。）の - 1 倍のリターンに加え、貸出金利とリバランスに伴う印紙税及び信用売りをしている株が支払いうる配当金も反映されるため、正確に - 1 倍として計算されるわけではありません。ただし、以下では説明の簡略化のために、「- 1 倍」としていることにご注意ください。

・ ハンセン中国企業株ショート指数は、変動率が原指数の日々の変動率の - 1 倍となるように算出されているため、前営業日と比較するとその変動率は原指数の - 1 倍となりますが、2 営業日以上離れた期間での比較においては、複利効果により、原指数の変動率の - 1 倍以上又は未滿となる場合があります。

・ ハンセン中国企業株ショート指数は、原指数が下落トレンドにある場合において上昇する指標であるため、ハンセン中国企業株指数原指数の下落を見込む場合には有効です。また、上昇局面においては、原指数の動きと逆に下落していく傾向があります。

・ インバース型指標は、中長期にわたって投資をする場合、原指数の変動率とインバース型指標の変動率の乖離が大きくなる可能性があり、留意が必要です。

・ 原指数の上昇と下落が相互に繰り返されるような相場においては、複利効果により、原指数と比較して指数のパフォーマンスが逓減して行くという特性があり、投資者は利益を得にくくなりますので、留意が必要です。

・ 円換算した原指標の動きと、円換算したインバース型指標の動きには、為替変動の影響もあるので、留意が必要です。

中国H株ベア上場投信

開示基準日におけるHang Seng China Enterprises Index Futureの売建玉
(開示基準日における取引を含む。)

14年01月限

93 単位

	A	B
開示基準日までの追加申込	0 口	0 口
開示基準日までの換金(解約)請求	0 口	0 口

A：開示基準日の前営業日

B：開示基準日

会 社 名 シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社
(管理会社コード : 16714)
代表者名 代表取締役社長 水嶋 浩雅
(銘柄コード : 1579)
問合せ先 業務本部 山口 節一
(TEL : 03 - 5208-5211)

『日経平均ブル2倍上場投信』に関する日々の開示事項

開示基準日:平成26年1月20日

1. 上場 E T F の上場受益権口数
(開示基準日現在)

1,480,000 口

2. 上場 E T F の純資産総額
(開示基準日現在)

16,859,689,151 円

3. 上場 E T F の一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

11,392 円

4. 上場 E T F の一口あたりの純資産額と対象指標の終値の乖離率
(開示基準日現在)

0.16 %

$$\text{乖離率} = \left[\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right] \times 100 (\%)$$

5. 連動対象指標の特徴と留意点

日経平均レバレッジ・インデックス(対象指標)は、日経平均株価(以下、「日経平均」といいます。)の2倍の変動率で指数が動くよう設計されています。

日経平均レバレッジ・インデックスについては、以下のHPをご覧ください。

<https://www.simplexasset.com/jp/etf/top/unitport.html>

対象指標となるレバレッジ型指標の主な特徴および主な留意点

・日経平均レバレッジ・インデックスは、変動率が日経平均の日々の変動率の2倍となるように算出されているため、前営業日と比較するとその変動率は日経平均の2倍となりますが、2営業日以上離れた期間での比較においては、複利効果により、日経平均の変動率の2倍以上又は未滿となる場合があります。

・日経平均レバレッジ・インデックスは、日経平均が上昇局面においては、より大きなリターンを狙うことが可能ですが、下落局面においては、日経平均より大きく下落する傾向があります。また、日経平均が上昇・下落を相互に繰り返す場合、上記の複利効果により日経平均レバレッジ・インデックスは逡減していくという特性があり、このような場合、投資者は利益を得にくくなりますので留意が必要です。また、中長期にわたって投資をする場合、原指標の変動率とレバレッジ型指標の変動率の乖離が大きくなる可能性があり、留意が必要です。

以 上

日経平均ブル2倍上場投信

開示基準日における日経225先物取引の買建玉
14年03月限

2,063 単位

開示基準日における追加申込
開示基準日における換金(解約)請求

0 口
60,000 口

会 社 名 シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社
(管理会社コード：16714)
代表者名 代表取締役社長 水嶋 浩雅
(銘柄コード：1580)
問合せ先 業務本部 山口 節一
(TEL：03 - 5208-5211)

『日経平均ベア上場投信』に関する日々の開示事項

開示基準日:平成26年1月20日

1. 上場 E T F の上場受益権口数
(開示基準日現在)

792,000 口

2. 上場 E T F の純資産総額
(開示基準日現在)

6,728,045,074 円

3. 上場 E T F の一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

8,495 円

4. 上場 E T F の一口あたりの純資産額と対象指標の終値の乖離率
(開示基準日現在)

-0.09 %

$$\text{乖離率} = \left[\frac{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{特定の指標の終値}}{\text{前営業日の特定の指標の終値}} \right] \times 100 (\%)$$

5. 連動対象指標の特徴と留意点

日経平均インバース・インデックスは、日経平均株価（以下、「日経平均」といいます。）の逆の変動率（ - 1 倍の変動率）で指数が動くよう設計されています。

日経平均インバース・インデックスについては、以下のHPをご覧ください。

<https://www.simplexasset.com/jp/etf/top/unitport.html>

対象指標となるレバレッジ型指標の主な特徴および主な留意点

・日経平均インバース・インデックスは、変動率が日経平均の日々の変動率の逆（ - 1 倍）となるように算出されているため、前営業日と比較するとその変動率は日経平均の - 1 倍となりますが、2 営業日以上離れた期間での比較においては、複利効果により、日経平均の変動率の - 1 倍以上又は未滿となる場合があります。

・日経平均インバース・インデックスは、下落局面でもリターンを狙うことが可能ですが、上昇局面においては、日経平均の動きと逆に下落していく傾向があります。また、日経平均が上昇・下落を相互に繰り返す場合、上記の複利効果により日経平均インバース・インデックスは逓減していくという特性があり、このような場合、投資者は利益を得にくくなりますので留意が必要です。また、インバース型指標は、中長期にわたって投資をする場合、原指標の変動率とインバース型指標の変動率の乖離が大きくなる可能性があり、留意が必要です。

以 上

日経平均ベア上場投信

開示基準日における日経225先物取引の売建玉
14年03月限

430 単位

開示基準日における追加申込
開示基準日における換金(解約)請求

0 口

0 口