

平成26年3月26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 3 月 2 5 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)

『WTI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3月25日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

234,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

1,521,436,047 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

6,502 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)

0.04 %

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

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3月25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)

1,741,847,225 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)

15,980 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)

『JASDAQ - TOP 20 上場投信』に関する日々の開示事項

開示基準日:平成26年3月25日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

553,809 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

2,652,883,351 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

4,790 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)

0.03 %

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

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)

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
2014/01/23	6,045.43	-1.91%	6,063	-1.91%	0.00%	553,809	3,357,741,334
2014/01/24	5,959.27	-1.43%	5,977	-1.42%	0.01%	553,809	3,309,972,032
2014/01/27	5,626.82	-5.58%	5,644	-5.57%	0.01%	553,809	3,125,696,955
2014/01/28	5,548.07	-1.40%	5,565	-1.40%	0.00%	553,809	3,082,033,921
2014/01/29	5,903.92	6.41%	5,921	6.40%	-0.02%	553,809	3,279,048,078
2014/01/30	5,749.76	-2.61%	5,767	-2.60%	0.01%	553,809	3,193,626,019
2014/01/31	5,749.00	-0.01%	5,766	-0.02%	0.00%	553,809	3,193,151,612
2014/02/03	5,391.99	-6.21%	5,409	-6.19%	0.02%	553,809	2,995,281,315
2014/02/04	5,344.55	-0.88%	5,374	-0.65%	0.23%	553,809	2,975,983,065
2014/02/05	5,304.06	-0.76%	5,333	-0.76%	-0.01%	553,809	2,953,509,775
2014/02/06	5,548.88	4.62%	5,578	4.59%	-0.02%	553,809	3,089,043,140
2014/02/07	5,600.69	0.93%	5,630	0.93%	0.00%	553,809	3,117,681,962
2014/02/10	5,794.42	3.46%	5,823	3.43%	-0.03%	553,809	3,224,812,342
2014/02/12	5,859.52	1.12%	5,888	1.12%	-0.01%	553,809	3,260,757,376
2014/02/13	5,752.05	-1.83%	5,780	-1.83%	0.00%	553,809	3,201,187,582
2014/02/14	5,615.40	-2.38%	5,644	-2.35%	0.02%	553,809	3,125,461,230
2014/02/17	5,618.14	0.05%	5,646	0.04%	-0.01%	553,809	3,126,823,655
2014/02/18	5,887.98	4.80%	5,916	4.78%	-0.02%	553,809	3,276,207,584
2014/02/19	5,842.82	-0.77%	5,871	-0.76%	0.01%	553,809	3,251,144,347
2014/02/20	5,729.11	-1.95%	5,757	-1.94%	0.00%	553,809	3,188,118,782
2014/02/21	5,745.30	0.28%	5,775	0.31%	0.03%	553,809	3,198,013,714
2014/02/24	5,868.45	2.14%	5,896	2.10%	-0.05%	553,809	3,265,070,961
2014/02/25	6,115.91	4.22%	6,143	4.19%	-0.03%	553,809	3,402,060,977
2014/02/26	5,981.04	-2.21%	6,008	-2.20%	0.01%	553,809	3,327,315,327
2014/02/27	5,662.74	-5.32%	5,690	-5.29%	0.03%	553,809	3,150,989,391
2014/02/28	5,605.00	-1.02%	5,632	-1.02%	0.00%	553,809	3,118,959,712
2014/03/03	5,549.49	-0.99%	5,576	-0.99%	0.00%	553,809	3,088,064,440
2014/03/04	5,611.75	1.12%	5,638	1.11%	-0.01%	553,809	3,122,492,301
2014/03/05	5,747.99	2.43%	5,774	2.41%	-0.02%	553,809	3,197,889,375
2014/03/06	5,846.48	1.71%	5,873	1.71%	0.00%	553,809	3,252,378,856
2014/03/07	5,861.95	0.26%	5,888	0.26%	-0.01%	553,809	3,260,895,876
2014/03/10	5,915.03	0.91%	5,941	0.90%	-0.01%	553,809	3,290,127,576
2014/03/11	5,800.00	-1.94%	5,826	-1.94%	0.01%	553,809	3,226,370,812
2014/03/12	5,654.57	-2.51%	5,680	-2.51%	0.00%	553,809	3,145,783,154
2014/03/13	5,585.11	-1.23%	5,611	-1.21%	0.01%	553,809	3,107,262,470
2014/03/14	5,420.51	-2.95%	5,446	-2.94%	0.01%	553,809	3,016,054,898
2014/03/17	5,289.70	-2.41%	5,315	-2.41%	0.01%	553,809	2,943,464,617
2014/03/18	5,378.75	1.68%	5,404	1.67%	-0.01%	553,809	2,992,731,537
2014/03/19	5,293.05	-1.59%	5,318	-1.59%	0.00%	553,809	2,945,221,278
2014/03/20	5,143.05	-2.83%	5,168	-2.82%	0.01%	553,809	2,862,107,249
2014/03/24	5,095.66	-0.92%	5,120	-0.93%	-0.01%	553,809	2,835,666,349
2014/03/25	4,765.69	-6.48%	4,790	-6.45%	0.03%	553,809	2,652,883,351

JASDAQ-TOP20上場投信(交換に係わる交換口数)

※平成26年3月27日は交換不可日のため、受け付けておりません

JASDAQ-TOP20上場投信(設定ポートフォリオ)

※平成26年3月27日は設定不可日のため、受け付けておりません

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3月25日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

660,144 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

1,416,223,471 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

2,145 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)

-0.01 %

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

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
2014/01/20	2,907.87	-0.61%	2,893	-0.62%	-0.01%	874,000	2,528,541,220
2014/01/21	2,881.60	-0.90%	2,867	-0.90%	0.00%	874,000	2,505,700,472
2014/01/22	2,977.02	3.31%	2,962	3.31%	0.00%	874,000	2,588,436,161
2014/01/23	2,939.82	-1.25%	2,925	-1.25%	0.00%	874,000	2,556,107,269
2014/01/24	2,926.68	-0.45%	2,912	-0.44%	0.00%	874,000	2,544,660,994
2014/01/27	2,784.97	-4.84%	2,771	-4.84%	0.00%	874,000	2,421,547,879
2014/01/28	2,732.99	-1.87%	2,719	-1.88%	-0.01%	874,000	2,376,396,177
2014/01/29	2,855.64	4.49%	2,841	4.49%	0.00%	874,000	2,482,772,339
2014/01/30	2,731.09	-4.36%	2,717	-4.36%	0.00%	874,000	2,374,655,468
2014/01/31	2,656.21	-2.74%	2,643	-2.72%	0.02%	874,000	2,309,629,662
2014/02/03	2,476.44	-6.77%	2,464	-6.77%	0.00%	874,000	2,153,511,294
2014/02/04	2,293.00	-7.41%	2,282	-7.39%	0.02%	874,000	1,994,308,724
2014/02/05	2,291.78	-0.05%	2,281	-0.04%	0.01%	824,649	1,880,651,192
2014/02/06	2,424.58	5.79%	2,412	5.74%	-0.05%	824,649	1,989,313,109
2014/02/07	2,375.16	-2.04%	2,363	-2.03%	0.01%	824,649	1,948,822,966
2014/02/10	2,459.94	3.57%	2,447	3.55%	-0.01%	818,066	2,001,996,251
2014/02/12	2,475.95	0.65%	2,463	0.65%	0.00%	818,066	2,014,910,589
2014/02/13	2,409.55	-2.68%	2,397	-2.68%	0.00%	818,066	1,960,954,805
2014/02/14	2,424.88	0.64%	2,412	0.63%	-0.01%	818,066	1,973,504,043
2014/02/17	2,504.35	3.28%	2,491	3.28%	0.00%	785,148	1,955,916,173
2014/02/18	2,479.80	-0.98%	2,467	-0.96%	0.02%	734,125	1,810,891,020
2014/02/19	2,498.43	0.75%	2,485	0.73%	-0.02%	734,125	1,824,427,346
2014/02/20	2,418.71	-3.19%	2,406	-3.18%	0.01%	734,125	1,766,318,106
2014/02/21	2,436.95	0.75%	2,425	0.79%	0.04%	734,125	1,780,077,449
2014/02/24	2,426.91	-0.41%	2,415	-0.41%	0.00%	734,125	1,773,205,579
2014/02/25	2,440.86	0.57%	2,429	0.58%	0.00%	734,125	1,783,538,244
2014/02/26	2,421.53	-0.79%	2,408	-0.86%	-0.07%	734,125	1,768,076,472
2014/02/27	2,394.36	-1.12%	2,381	-1.12%	0.00%	734,125	1,748,282,629
2014/02/28	2,445.08	2.12%	2,432	2.14%	0.02%	734,125	1,785,137,657
2014/03/03	2,388.18	-2.33%	2,375	-2.34%	-0.02%	734,125	1,743,644,076
2014/03/04	2,420.00	1.33%	2,407	1.35%	0.01%	734,125	1,766,748,831
2014/03/05	2,449.06	1.20%	2,435	1.16%	-0.04%	734,125	1,787,850,627
2014/03/06	2,466.98	0.73%	2,453	0.74%	0.01%	734,125	1,800,853,030
2014/03/07	2,520.82	2.18%	2,506	2.16%	-0.02%	734,125	1,839,976,690
2014/03/10	2,554.47	1.33%	2,540	1.36%	0.02%	734,125	1,864,340,252
2014/03/11	2,598.71	1.73%	2,583	1.69%	-0.04%	734,125	1,896,476,231
2014/03/12	2,571.73	-1.04%	2,557	-1.01%	0.03%	734,125	1,876,813,611
2014/03/13	2,569.10	-0.10%	2,554	-0.12%	-0.02%	734,125	1,874,862,358
2014/03/14	2,494.15	-2.92%	2,480	-2.90%	0.02%	734,125	1,820,312,140
2014/03/17	2,347.56	-5.88%	2,334	-5.89%	-0.01%	734,125	1,713,580,358
2014/03/18	2,389.65	1.79%	2,376	1.80%	0.01%	660,144	1,568,396,151
2014/03/19	2,344.44	-1.89%	2,331	-1.89%	0.00%	660,144	1,538,804,667
2014/03/20	2,204.64	-5.96%	2,193	-5.92%	0.04%	660,144	1,447,373,016
2014/03/24	2,251.57	2.13%	2,239	2.10%	-0.03%	660,144	1,477,934,002
2014/03/25	2,157.23	-4.19%	2,145	-4.20%	-0.01%	660,144	1,416,223,471

マザーズ・コア上場投信(交換に係わる交換口数)

※平成26年3月27日は交換不可日のため、受け付けておりません

マザーズ・コア上場投信(設定ポートフォリオ)

※平成26年3月27日は設定不可日のため、受け付けておりません

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3月25日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

30,318 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

381,148,348 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

12,572 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)

-0.59 %

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

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ヵ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(SQ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HP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SQ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、SQ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ことがあります。

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
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
2014/01/21	13,885.15	0.94%	13,712	0.71%	-0.23%	30,318	415,709,735
2014/01/22	13,912.48	0.20%	13,751	0.28%	0.09%	30,318	416,898,292
2014/01/23	13,816.33	-0.69%	13,653	-0.71%	-0.02%	30,318	413,927,491
2014/01/24	13,559.51	-1.86%	13,441	-1.55%	0.31%	30,318	407,501,728
2014/01/27	13,224.67	-2.47%	13,017	-3.15%	-0.69%	30,318	394,635,666
2014/01/28	13,202.13	-0.17%	13,068	0.39%	0.56%	30,318	396,188,204
2014/01/29	13,553.65	2.66%	13,389	2.46%	-0.21%	30,318	405,934,685
2014/01/30	13,226.73	-2.41%	13,060	-2.46%	-0.05%	30,318	395,944,045
2014/01/31	13,146.92	-0.60%	12,941	-0.91%	-0.31%	30,318	392,348,566
2014/02/03	12,886.51	-1.98%	12,692	-1.92%	0.06%	30,318	384,785,968
2014/02/04	12,348.19	-4.18%	12,143	-4.33%	-0.15%	30,318	368,138,454
2014/02/05	12,499.74	1.23%	12,365	1.83%	0.60%	30,318	374,891,661
2014/02/06	12,477.47	-0.18%	12,339	-0.21%	-0.03%	30,318	374,095,104
2014/02/07	12,748.36	2.17%	12,638	2.42%	0.25%	30,318	383,162,870
2014/02/10	12,973.97	1.77%	12,836	1.57%	-0.20%	30,318	389,147,637
2014/02/12	13,046.01	0.56%	12,869	0.26%	-0.30%	30,318	390,173,200
2014/02/13	12,812.12	-1.79%	12,638	-1.80%	0.00%	30,318	383,146,715
2014/02/14	12,617.55	-1.52%	12,492	-1.16%	0.36%	30,318	378,729,652
2014/02/17	12,684.06	0.53%	12,555	0.50%	-0.02%	30,318	380,657,414
2014/02/18	12,994.23	2.45%	12,838	2.25%	-0.19%	30,318	389,230,485
2014/02/19	12,952.85	-0.32%	12,804	-0.26%	0.05%	30,318	388,183,133
2014/02/20	12,738.16	-1.66%	12,568	-1.84%	-0.19%	30,318	381,026,533
2014/02/21	13,031.82	2.31%	12,846	2.21%	-0.09%	30,318	389,469,729
2014/02/24	13,020.31	-0.09%	12,867	0.16%	0.25%	30,318	390,096,816
2014/02/25	13,183.24	1.25%	12,978	0.86%	-0.39%	30,318	393,469,879
2014/02/26	13,133.96	-0.37%	12,999	0.16%	0.54%	30,318	394,112,893
2014/02/27	13,113.71	-0.15%	12,986	-0.10%	0.05%	30,318	393,717,396
2014/02/28	13,076.47	-0.28%	12,935	-0.39%	-0.11%	30,318	392,150,404
2014/03/03	12,949.05	-0.97%	12,775	-1.24%	-0.26%	30,318	387,318,005
2014/03/04	12,992.68	0.34%	12,938	1.28%	0.94%	30,318	392,251,718
2014/03/05	13,153.16	1.24%	12,976	0.29%	-0.94%	30,318	393,415,054
2014/03/06	13,310.07	1.19%	13,130	1.19%	-0.01%	30,318	398,089,575
2014/03/07	13,393.63	0.63%	13,237	0.81%	0.19%	30,318	401,333,129
2014/03/10	13,319.28	-0.56%	13,185	-0.39%	0.16%	30,318	399,740,155
2014/03/11	13,424.67	0.79%	13,240	0.42%	-0.37%	30,318	401,423,086
2014/03/12	13,134.35	-2.16%	12,951	-2.18%	-0.02%	30,318	392,637,611
2014/03/13	13,124.24	-0.08%	12,902	-0.38%	-0.30%	30,318	391,148,943
2014/03/14	12,692.53	-3.29%	12,517	-2.98%	0.31%	30,318	379,485,508
2014/03/17	12,654.34	-0.30%	12,565	0.38%	0.68%	30,318	380,945,426
2014/03/18	12,774.78	0.95%	12,627	0.49%	-0.46%	30,318	382,810,333
2014/03/19	12,820.30	0.36%	12,695	0.54%	0.18%	30,318	384,883,809
2014/03/20	12,621.97	-1.55%	12,459	-1.86%	-0.31%	30,318	377,726,640
2014/03/24	12,843.20	1.75%	12,688	1.84%	0.09%	30,318	384,665,518
2014/03/25	12,801.36	-0.33%	12,572	-0.91%	-0.59%	30,318	381,148,348

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3月26日)、交換受付日(平成26年3月26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06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04月限 行使価格	26 単位 15,625 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HP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)

『TOPIX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3月25日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

2,070,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

36,705,528,500 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

17,732 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)

-1.08 %

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

5. 連動対象指標の特徴と留意点

TOPIX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TOPIX(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 × TOPIX(配当なし)の前日比変動率)

TOPIXレバレッジ(2倍)指数については、以下のHP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

・TOPIXレバレッジ(2倍)指数は、変動率がTOPIX(配当なし)(以下、「TOPIX」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TOPIX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、TOPIXの変動率の2倍以上又は未滿となる場合があります。

・TOPIXレバレッジ(2倍)指数は、TOPIX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、TOPIXより大きく下落する傾向があります。また、TOPIX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TOPIXレバレッジ(2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、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

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06月限	6,398 単位
-----------------------------------	----------

開示基準日における追加申込	0 口
開示基準日における換金(解約)請求	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)

『TOPIX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3月25日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

1,016,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

6,347,900,726 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

6,248 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)

0.54 %

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

5. 連動対象指標の特徴と留意点

TOPIX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TOPIX(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 × TOPIX(配当なし)の前日比変動率)

TOPIXインバース(-1倍)指数については、以下のHP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

・TOPIXインバース(-1倍)指数は、変動率がTOPIX(配当なし)(以下、「TOPIX」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TOPIX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、TOPIXの変動率の-1倍以上又は未滿となる場合があります。

・TOPIX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、TOPIXの動きと逆に下落していく傾向があります。また、TOPIX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TOPIXインバース(-1倍)指数は遞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06月限	549 単位
開示基準日における追加申込	0 口
開示基準日における換金(解約)請求	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3月25日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

60,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

573,906,208 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

9,565 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)

0.08 %

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

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倍以上又は未満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用です。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逡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03月限

180 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3月25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)

629,212,018 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

12,584 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)

-0.29 %

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

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逡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03月限

99 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3月25日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

2,440,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

22,912,937,144 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

9,391 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)

-1.22 %

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

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06月限 3,225 単位

開示基準日における追加申込 0 口
開示基準日における換金(解約)請求 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: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3月25日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

1,152,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

10,543,867,789 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

9,153 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)

0.61 %

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

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06月限	734 単位
開示基準日における追加申込	0 口
開示基準日における換金(解約)請求	0 口