

平成26年8月27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 8 月 2 6 日の状況をご報告します。

上場ETF銘柄(12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
12	TOPIXベア2倍上場投信	1356	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8月26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)

1,510,089,403 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

6,453 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8月26日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

109,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

1,859,814,582 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

17,063 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8月26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)

2,812,113,419 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

5,078 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)

0.02 %

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

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
2014/06/27	5,586.23	-1.10%	5,612	-1.09%	0.01%	553,809	3,108,041,707
2014/06/30	5,650.21	1.15%	5,676	1.14%	0.00%	553,809	3,143,223,545
2014/07/01	5,694.96	0.79%	5,720	0.78%	-0.02%	553,809	3,167,922,992
2014/07/02	5,875.20	3.16%	5,900	3.15%	-0.02%	553,809	3,267,649,130
2014/07/03	5,804.06	-1.21%	5,829	-1.20%	0.01%	553,809	3,228,166,126
2014/07/04	5,804.62	0.01%	5,829	0.00%	-0.01%	553,809	3,228,389,074
2014/07/07	5,769.86	-0.60%	5,794	-0.60%	0.00%	553,809	3,208,882,102
2014/07/08	5,747.43	-0.39%	5,772	-0.38%	0.01%	553,809	3,196,376,068
2014/07/09	5,581.76	-2.88%	5,606	-2.88%	0.01%	553,809	3,104,558,111
2014/07/10	5,471.50	-1.98%	5,495	-1.98%	0.00%	553,809	3,043,426,463
2014/07/11	5,534.67	1.15%	5,558	1.15%	-0.01%	553,809	3,078,341,352
2014/07/14	5,546.24	0.21%	5,570	0.22%	0.01%	553,809	3,084,536,489
2014/07/15	5,659.14	2.04%	5,682	2.01%	-0.02%	553,809	3,146,987,788
2014/07/16	5,505.04	-2.72%	5,528	-2.71%	0.01%	553,809	3,061,576,593
2014/07/17	5,474.80	-0.55%	5,498	-0.54%	0.01%	553,809	3,044,758,439
2014/07/18	5,424.41	-0.92%	5,447	-0.93%	-0.01%	553,809	3,016,785,111
2014/07/22	5,441.87	0.32%	5,465	0.33%	0.01%	553,809	3,026,290,295
2014/07/23	5,463.84	0.40%	5,486	0.38%	-0.02%	553,809	3,038,416,975
2014/07/24	5,430.40	-0.61%	5,453	-0.60%	0.01%	553,809	3,019,858,367
2014/07/25	5,451.71	0.39%	5,474	0.39%	-0.01%	553,809	3,031,620,194
2014/07/28	5,434.00	-0.32%	5,456	-0.33%	0.00%	553,809	3,021,691,951
2014/07/29	5,419.80	-0.26%	5,442	-0.26%	0.00%	553,809	3,013,783,381
2014/07/30	5,404.57	-0.28%	5,427	-0.28%	0.01%	553,809	3,005,312,721
2014/07/31	5,321.92	-1.53%	5,344	-1.53%	0.00%	553,809	2,959,497,272
2014/08/01	5,220.08	-1.91%	5,242	-1.91%	0.00%	553,809	2,903,060,577
2014/08/04	5,303.14	1.59%	5,325	1.58%	-0.01%	553,809	2,948,943,139
2014/08/05	5,119.11	-3.47%	5,141	-3.46%	0.01%	553,809	2,846,988,309
2014/08/06	5,028.84	-1.76%	5,050	-1.77%	-0.01%	553,809	2,796,960,110
2014/08/07	4,982.66	-0.92%	5,004	-0.91%	0.01%	553,809	2,771,351,421
2014/08/08	4,887.93	-1.90%	4,909	-1.90%	0.00%	553,809	2,718,851,498
2014/08/11	4,905.79	0.37%	4,927	0.37%	0.00%	553,809	2,728,633,165
2014/08/12	5,082.01	3.59%	5,103	3.57%	-0.02%	553,809	2,826,187,620
2014/08/13	5,019.04	-1.24%	5,040	-1.23%	0.00%	553,809	2,791,277,550
2014/08/14	5,006.31	-0.25%	5,027	-0.26%	0.00%	553,809	2,784,186,901
2014/08/15	5,020.41	0.28%	5,041	0.28%	0.00%	553,809	2,791,961,444
2014/08/18	4,952.02	-1.36%	4,973	-1.35%	0.01%	553,809	2,753,970,017
2014/08/19	4,951.71	-0.01%	4,972	-0.02%	-0.01%	553,809	2,753,764,121
2014/08/20	4,953.49	0.04%	4,974	0.04%	0.00%	553,809	2,754,710,031
2014/08/21	5,055.88	2.07%	5,076	2.05%	-0.02%	553,809	2,811,379,148
2014/08/22	5,117.33	1.22%	5,138	1.22%	0.01%	553,809	2,845,370,134
2014/08/25	5,154.12	0.72%	5,174	0.70%	-0.02%	553,809	2,865,626,663
2014/08/26	5,057.56	-1.87%	5,078	-1.86%	0.02%	553,809	2,812,113,419

JASDAQ-TOP20上場投信(交換に係わる交換口数)

※平成26年8月28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8月28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8月26日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

559,864 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

2,288,789,661 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

4,088 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
2014/06/24	3,479.53	-0.15%	3,454	-0.14%	0.00%	470,900	1,626,518,170
2014/06/25	3,462.15	-0.50%	3,437	-0.49%	0.01%	470,900	1,618,358,330
2014/06/26	3,358.08	-3.01%	3,338	-2.88%	0.13%	470,900	1,572,023,455
2014/06/27	3,374.60	0.49%	3,355	0.51%	0.02%	470,900	1,579,651,910
2014/06/30	3,498.86	3.68%	3,477	3.64%	-0.05%	470,900	1,637,335,384
2014/07/01	3,566.89	1.94%	3,544	1.93%	-0.02%	470,900	1,668,961,342
2014/07/02	3,609.17	1.19%	3,586	1.19%	0.00%	470,900	1,688,588,282
2014/07/03	3,565.91	-1.20%	3,543	-1.20%	0.00%	470,900	1,668,371,828
2014/07/04	3,555.33	-0.30%	3,532	-0.31%	-0.01%	470,900	1,663,374,736
2014/07/07	3,542.97	-0.35%	3,520	-0.34%	0.01%	470,900	1,657,418,266
2014/07/08	3,566.83	0.67%	3,543	0.65%	-0.02%	470,900	1,668,466,802
2014/07/09	3,566.89	0.00%	3,543	0.00%	0.00%	470,900	1,668,438,677
2014/07/10	3,545.54	-0.60%	3,522	-0.59%	0.01%	470,900	1,658,435,555
2014/07/11	3,534.59	-0.31%	3,511	-0.31%	0.00%	470,900	1,653,277,556
2014/07/14	3,593.38	1.66%	3,569	1.65%	-0.01%	470,900	1,680,496,121
2014/07/15	3,651.75	1.62%	3,626	1.60%	-0.03%	470,900	1,707,627,801
2014/07/16	3,600.23	-1.41%	3,575	-1.41%	0.00%	470,900	1,683,573,372
2014/07/17	3,598.83	-0.04%	3,574	-0.03%	0.01%	470,900	1,682,860,693
2014/07/18	3,587.02	-0.33%	3,562	-0.34%	-0.01%	470,900	1,677,303,192
2014/07/22	3,587.81	0.02%	3,563	0.03%	0.01%	470,900	1,677,581,628
2014/07/23	3,663.50	2.11%	3,637	2.08%	-0.03%	470,900	1,712,813,021
2014/07/24	3,678.06	0.40%	3,652	0.41%	0.01%	470,900	1,719,572,521
2014/07/25	3,666.92	-0.30%	3,641	-0.30%	0.00%	470,900	1,714,362,087
2014/07/28	3,830.89	4.47%	3,803	4.45%	-0.02%	470,900	1,790,671,856
2014/07/29	4,010.64	4.69%	3,980	4.65%	-0.04%	470,900	1,874,380,361
2014/07/30	3,952.64	-1.45%	3,923	-1.43%	0.01%	470,900	1,847,336,744
2014/07/31	4,214.86	6.63%	4,182	6.60%	-0.03%	470,900	1,969,462,423
2014/08/01	4,289.62	1.77%	4,256	1.77%	0.00%	470,900	2,004,262,629
2014/08/04	4,300.57	0.26%	4,267	0.26%	0.00%	470,900	2,009,282,350
2014/08/05	3,953.80	-8.06%	3,924	-8.04%	0.02%	470,900	1,847,718,986
2014/08/06	3,883.99	-1.77%	3,855	-1.76%	0.01%	470,900	1,815,175,315
2014/08/07	3,756.49	-3.28%	3,729	-3.27%	0.01%	470,900	1,755,756,571
2014/08/08	3,584.57	-4.58%	3,558	-4.59%	-0.01%	470,900	1,675,647,670
2014/08/11	3,885.28	8.39%	3,856	8.38%	-0.01%	470,900	1,815,656,973
2014/08/12	4,163.40	7.16%	4,131	7.13%	-0.03%	470,900	1,945,193,258
2014/08/13	4,206.11	1.03%	4,173	1.02%	-0.01%	470,900	1,965,059,985
2014/08/14	4,083.75	-2.91%	4,052	-2.90%	0.01%	541,742	2,195,057,124
2014/08/15	4,090.97	0.18%	4,059	0.17%	0.00%	541,742	2,198,897,079
2014/08/18	3,996.44	-2.31%	3,965	-2.32%	-0.01%	541,742	2,148,129,240
2014/08/19	4,067.66	1.78%	4,036	1.79%	0.01%	543,390	2,192,929,065
2014/08/20	4,019.32	-1.19%	3,988	-1.19%	0.00%	559,864	2,232,605,877
2014/08/21	4,013.08	-0.16%	3,982	-0.15%	0.00%	559,864	2,229,116,624
2014/08/22	4,025.26	0.30%	3,994	0.30%	0.00%	559,864	2,235,830,861
2014/08/25	4,106.63	2.02%	4,074	2.00%	-0.02%	559,864	2,280,821,894
2014/08/26	4,121.07	0.35%	4,088	0.34%	-0.01%	559,864	2,288,789,661

マザーズ・コア上場投信(交換に係わる交換口数)

※平成26年8月28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8月28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8月26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)

419,576,254 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)

13,839 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. 交換にかかる有価証券のポートフォリオ (交換不可)
(注記参照)

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(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
2014/06/20	13,777.61	-0.08%	13,653	0.26%	0.33%	30,318	413,941,246
2014/06/23	13,800.06	0.16%	13,629	-0.18%	-0.34%	30,318	413,214,180
2014/06/24	13,806.34	0.05%	13,673	0.32%	0.28%	30,318	414,546,945
2014/06/25	13,744.37	-0.45%	13,585	-0.64%	-0.19%	30,318	411,856,986
2014/06/26	13,785.79	0.30%	13,641	0.41%	0.11%	30,318	413,568,402
2014/06/27	13,612.90	-1.25%	13,482	-1.17%	0.09%	30,318	408,745,158
2014/06/30	13,675.29	0.46%	13,518	0.27%	-0.19%	30,318	409,827,449
2014/07/01	13,815.33	1.02%	13,643	0.92%	-0.10%	30,318	413,616,980
2014/07/02	13,850.34	0.25%	13,700	0.42%	0.16%	30,318	415,353,513
2014/07/03	13,841.60	-0.06%	13,657	-0.31%	-0.25%	30,318	414,041,463
2014/07/04	13,920.91	0.57%	13,762	0.77%	0.20%	30,318	417,237,516
2014/07/07	13,878.75	-0.30%	13,717	-0.33%	-0.02%	30,318	415,862,199
2014/07/08	13,824.55	-0.39%	13,685	-0.23%	0.16%	30,318	414,900,514
2014/07/09	13,815.74	-0.06%	13,651	-0.25%	-0.18%	30,318	413,857,539
2014/07/10	13,737.93	-0.56%	13,605	-0.34%	0.23%	30,318	412,490,899
2014/07/11	13,691.49	-0.34%	13,533	-0.53%	-0.19%	30,318	410,304,929
2014/07/14	13,807.93	0.85%	13,662	0.95%	0.10%	30,318	414,194,488
2014/07/15	13,892.32	0.61%	13,728	0.48%	-0.13%	30,318	416,201,914
2014/07/16	13,881.60	-0.08%	13,713	-0.11%	-0.03%	30,318	415,752,292
2014/07/17	13,881.56	0.00%	13,712	-0.01%	-0.01%	30,318	415,707,688
2014/07/18	13,749.96	-0.95%	13,577	-0.98%	-0.04%	30,318	411,613,085
2014/07/22	13,863.49	0.83%	13,680	0.76%	-0.07%	30,318	414,744,115
2014/07/23	13,851.99	-0.08%	13,681	0.01%	0.09%	30,318	414,784,270
2014/07/24	13,813.89	-0.28%	13,656	-0.18%	0.09%	30,318	414,011,063
2014/07/25	13,963.48	1.08%	13,781	0.92%	-0.17%	30,318	417,827,233
2014/07/28	14,020.02	0.40%	13,825	0.32%	-0.09%	30,318	419,160,309
2014/07/29	14,092.05	0.51%	13,933	0.78%	0.27%	30,318	422,412,312
2014/07/30	14,124.74	0.23%	13,930	-0.02%	-0.25%	30,318	422,343,899
2014/07/31	14,106.24	-0.13%	13,952	0.16%	0.29%	30,318	423,004,834
2014/08/01	14,022.46	-0.59%	13,894	-0.42%	0.18%	30,318	421,236,722
2014/08/04	13,988.46	-0.24%	13,795	-0.71%	-0.47%	30,318	418,250,957
2014/08/05	13,850.86	-0.98%	13,690	-0.76%	0.22%	30,318	415,050,646
2014/08/06	13,705.73	-1.05%	13,511	-1.31%	-0.26%	30,318	409,637,067
2014/08/07	13,771.35	0.48%	13,555	0.33%	-0.15%	30,318	410,973,284
2014/08/08	13,361.77	-2.97%	13,171	-2.83%	0.14%	30,318	399,313,063
2014/08/11	13,660.84	2.24%	13,479	2.34%	0.10%	30,318	408,667,480
2014/08/12	13,701.41	0.30%	13,509	0.22%	-0.07%	30,318	409,571,388
2014/08/13	13,745.18	0.32%	13,567	0.43%	0.11%	30,318	411,338,945
2014/08/14	13,834.81	0.65%	13,628	0.45%	-0.20%	30,318	413,161,118
2014/08/15	13,840.94	0.04%	13,657	0.21%	0.17%	30,318	414,037,917
2014/08/18	13,850.23	0.07%	13,669	0.09%	0.02%	30,318	414,426,590
2014/08/19	13,957.29	0.77%	13,750	0.59%	-0.18%	30,318	416,868,701
2014/08/20	13,964.23	0.05%	13,742	-0.06%	-0.11%	30,318	416,638,123
2014/08/21	14,064.55	0.72%	13,838	0.70%	-0.02%	30,318	419,539,548
2014/08/22	14,032.84	-0.23%	13,847	0.07%	0.29%	30,318	419,821,907
2014/08/25	14,093.59	0.43%	13,899	0.38%	-0.06%	30,318	421,399,280
2014/08/26	14,031.96	-0.44%	13,839	-0.43%	0.01%	30,318	419,576,254

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8月27日)、交換受付日(平成26年8月27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09月限	27 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09月限 行使価格	27 単位 16,000 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。

注 記

運用の変更にともない臨時的に交換請求を停止しております。

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8月26日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

1,020,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

22,267,877,563 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

21,831 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)

-0.34 %

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

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09月限	3,467 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8月26日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

836,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

4,617,614,731 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

5,523 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)

0.15 %

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

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09月限	359 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8月26日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

80,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

1,078,145,734 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

13,477 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08月限

290 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8月26日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

90,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

960,136,444 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

10,668 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)

-0.02 %

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

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08月限

128 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8月26日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

1,540,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

16,938,346,244 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

10,999 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. 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09月限	2,180 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8月26日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

902,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

7,474,775,900 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

8,287 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)

-0.02 %

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

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09月限	482 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：1356)
問合せ先 業務本部 山口 節一
(TEL：03 - 5208-5211)

『 T O P I X ベア 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8月26日

- 1 . 上 場 E T F の 上 場 受 益 権 口 数
(開 示 基 準 日 現 在)

570,000 口

- 2 . 上 場 E T F の 純 資 産 総 額
(開 示 基 準 日 現 在)

4,893,424,767 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)

8,585 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)

0.33 %

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

5 . 連 動 対 象 指 標 の 特 徴 と 留 意 点

TOPIXダブルインバース(-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ダブルインバース(-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ダブルインバース(-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ダブルインバース(-2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ダブルインバース(-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、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

TOPIXベア2倍上場投信

開示基準日におけるTOPIX先物取引の売建玉 14年09月限	787 単位
開示基準日における追加申込	20,000 口
開示基準日における換金(解約)請求	0 口