

平成26年12月5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ETF (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26年12月4日の状況をご報告します。

上場ETF銘柄(13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
13	日経平均ベア2倍上場投信	1360	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12月4日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

554,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

3,018,332,038 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

5,448 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)

-0.07 %

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

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12月4日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

77,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

1,583,873,965 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

20,570 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 %

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

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-TOP20上場投信』に関する日々の開示事項

開示基準日:平成26年12月4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)

2,365,901,665 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

4,272 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)

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
2014/10/01	4,648.58	-2.65%	4,672	-2.65%	0.00%	553,809	2,587,653,985
2014/10/02	4,577.14	-1.54%	4,601	-1.52%	0.02%	553,809	2,548,043,388
2014/10/03	4,665.79	1.94%	4,690	1.93%	0.00%	553,809	2,597,096,068
2014/10/06	4,669.03	0.07%	4,693	0.06%	-0.01%	553,809	2,598,757,306
2014/10/07	4,596.22	-1.56%	4,620	-1.56%	0.00%	553,809	2,558,387,897
2014/10/08	4,554.21	-0.91%	4,578	-0.91%	0.00%	553,809	2,535,075,731
2014/10/09	4,423.04	-2.88%	4,446	-2.88%	0.00%	553,809	2,462,392,147
2014/10/10	4,234.89	-4.25%	4,258	-4.23%	0.03%	553,809	2,358,153,046
2014/10/14	3,988.34	-5.82%	4,011	-5.80%	0.02%	553,809	2,221,444,284
2014/10/15	4,094.54	2.66%	4,117	2.64%	-0.02%	553,809	2,280,216,505
2014/10/16	3,906.95	-4.58%	3,930	-4.54%	0.04%	553,809	2,176,288,818
2014/10/17	3,898.18	-0.22%	3,921	-0.23%	0.00%	553,809	2,171,386,854
2014/10/20	4,047.30	3.83%	4,070	3.80%	-0.03%	553,809	2,253,881,849
2014/10/21	4,007.02	-1.00%	4,029	-1.01%	-0.01%	553,809	2,231,539,164
2014/10/22	4,229.41	5.55%	4,252	5.53%	-0.02%	553,809	2,354,670,428
2014/10/23	4,256.15	0.63%	4,278	0.61%	-0.02%	553,809	2,369,446,613
2014/10/24	4,268.23	0.28%	4,290	0.28%	0.00%	553,809	2,376,101,735
2014/10/27	4,324.15	1.31%	4,347	1.33%	0.02%	553,809	2,407,531,546
2014/10/28	4,336.53	0.29%	4,361	0.32%	0.04%	553,809	2,414,916,635
2014/10/29	4,418.02	1.88%	4,442	1.86%	-0.02%	553,809	2,460,011,775
2014/10/30	4,197.24	-5.00%	4,221	-4.98%	0.02%	553,809	2,337,714,713
2014/10/31	4,194.01	-0.08%	4,218	-0.07%	0.01%	553,809	2,335,892,908
2014/11/04	4,253.51	1.42%	4,277	1.40%	-0.02%	553,809	2,368,678,366
2014/11/07	4,302.54	1.15%	4,326	1.15%	-0.03%	553,809	2,395,820,471
2014/11/10	4,349.31	1.09%	4,373	1.09%	0.00%	553,809	2,421,594,650
2014/11/11	4,373.13	0.55%	4,396	0.53%	-0.02%	553,809	2,434,739,179
2014/11/12	4,349.26	-0.55%	4,372	-0.55%	0.00%	553,809	2,421,528,337
2014/11/13	4,346.07	-0.07%	4,369	-0.07%	0.00%	553,809	2,419,706,049
2014/11/14	4,342.02	-0.09%	4,365	-0.09%	0.00%	553,809	2,417,429,636
2014/11/17	4,298.17	-1.01%	4,321	-1.01%	0.00%	553,809	2,393,077,698
2014/11/18	4,414.20	2.70%	4,437	2.68%	-0.01%	553,809	2,457,229,211
2014/11/19	4,403.73	-0.24%	4,426	-0.25%	-0.01%	553,809	2,451,402,355
2014/11/20	4,308.19	-2.17%	4,331	-2.15%	0.02%	553,809	2,398,494,863
2014/11/21	4,332.73	0.57%	4,355	0.55%	-0.02%	553,809	2,412,015,615
2014/11/25	4,381.75	1.13%	4,404	1.13%	-0.01%	553,809	2,438,919,035
2014/11/26	4,352.85	-0.66%	4,375	-0.66%	0.00%	553,809	2,422,874,916
2014/11/27	4,303.57	-1.13%	4,326	-1.12%	0.01%	553,809	2,395,556,182
2014/11/28	4,316.19	0.29%	4,338	0.28%	-0.02%	553,809	2,402,488,185
2014/12/01	4,310.80	-0.12%	4,332	-0.14%	-0.01%	553,809	2,399,342,704
2014/12/02	4,308.80	-0.05%	4,330	-0.05%	0.00%	553,809	2,398,180,739
2014/12/03	4,308.80	0.00%	4,330	0.00%	0.00%	553,809	2,398,133,078
2014/12/04	4,250.64	-1.35%	4,272	-1.34%	0.01%	553,809	2,365,901,665

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12月8日)、交換受付日(平成26年12月8日)分の交換口数は以下のとおりです。

交換口数 : 1,939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12月8日)、設定受付日(平成26年12月8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	2337	いちごグループホールディングス	100
4	2400	メッセージ	100
5	2461	ファンコミュニケーションズ	200
6	2656	ベクター	100
7	2702	日本マクドナルドホールディングス	100
8	2782	セリア	100
9	3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	10000
10	3858	ユビキタス	100
11	4080	田中化学研究所	100
12	4239	ポラテクノ	200
13	4348	インフォコム	200
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	200

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12月4日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

550,776 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

2,150,871,225 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

3,905 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
2014/09/26	3,959.79	3.50%	3,936	3.72%	0.21%	619,172	2,436,953,665
2014/09/29	3,993.81	0.86%	3,969	0.84%	-0.02%	619,172	2,457,663,814
2014/09/30	3,940.28	-1.34%	3,916	-1.34%	0.00%	619,172	2,424,804,486
2014/10/01	3,840.25	-2.54%	3,817	-2.53%	0.01%	619,172	2,363,445,587
2014/10/02	3,789.41	-1.32%	3,767	-1.31%	0.01%	619,172	2,332,237,661
2014/10/03	3,902.65	2.99%	3,879	2.97%	-0.02%	619,172	2,401,609,618
2014/10/06	3,958.51	1.43%	3,934	1.42%	-0.01%	619,172	2,435,709,508
2014/10/07	3,880.69	-1.97%	3,857	-1.96%	0.01%	619,172	2,387,963,139
2014/10/08	3,945.05	1.66%	3,920	1.63%	-0.03%	619,172	2,427,367,428
2014/10/09	3,847.96	-2.46%	3,824	-2.45%	0.01%	619,172	2,367,808,710
2014/10/10	3,797.91	-1.30%	3,775	-1.28%	0.02%	569,829	2,150,857,195
2014/10/14	3,641.53	-4.12%	3,620	-4.11%	0.01%	569,829	2,062,507,502
2014/10/15	3,742.36	2.77%	3,719	2.73%	-0.03%	569,829	2,119,322,829
2014/10/16	3,643.49	-2.64%	3,621	-2.64%	0.01%	569,829	2,063,529,265
2014/10/17	3,737.10	2.57%	3,714	2.57%	0.00%	471,149	1,749,775,466
2014/10/20	3,922.41	4.96%	3,897	4.93%	-0.03%	471,149	1,836,024,476
2014/10/21	3,783.41	-3.54%	3,759	-3.54%	0.00%	471,149	1,771,245,722
2014/10/22	3,842.27	1.56%	3,818	1.57%	0.01%	471,149	1,798,636,736
2014/10/23	3,976.19	3.49%	3,950	3.46%	-0.03%	471,149	1,860,996,927
2014/10/24	3,958.33	-0.45%	3,932	-0.46%	-0.01%	471,149	1,852,647,903
2014/10/27	3,956.12	-0.06%	3,930	-0.05%	0.00%	471,149	1,851,541,144
2014/10/28	4,061.35	2.66%	4,034	2.65%	-0.01%	471,149	1,900,533,893
2014/10/29	3,933.30	-3.15%	3,907	-3.15%	0.00%	471,149	1,840,855,510
2014/10/30	3,855.91	-1.97%	3,831	-1.95%	0.02%	471,149	1,804,775,865
2014/10/31	3,965.80	2.85%	3,941	2.87%	0.02%	471,149	1,856,697,099
2014/11/04	4,092.99	3.21%	4,066	3.17%	-0.04%	471,149	1,915,840,955
2014/11/07	4,218.69	3.07%	4,190	3.05%	-0.06%	471,149	1,974,327,296
2014/11/10	4,146.22	-1.72%	4,120	-1.67%	0.05%	471,149	1,941,046,513
2014/11/11	4,120.23	-0.63%	4,094	-0.63%	0.00%	471,149	1,928,908,851
2014/11/12	4,109.82	-0.25%	4,084	-0.24%	0.01%	471,149	1,924,032,347
2014/11/13	3,943.79	-4.04%	3,919	-4.04%	0.00%	471,149	1,846,651,907
2014/11/14	3,855.74	-2.23%	3,832	-2.22%	0.01%	471,149	1,805,604,085
2014/11/17	3,764.79	-2.36%	3,742	-2.35%	0.01%	471,149	1,763,154,951
2014/11/18	3,896.46	3.50%	3,872	3.47%	-0.02%	471,149	1,824,477,618
2014/11/19	3,863.59	-0.84%	3,840	-0.83%	0.02%	471,149	1,809,135,029
2014/11/20	3,817.34	-1.20%	3,794	-1.20%	0.00%	497,683	1,888,214,644
2014/11/21	3,859.55	1.11%	3,836	1.11%	0.00%	497,683	1,908,942,293
2014/11/25	3,952.89	2.42%	3,928	2.40%	-0.02%	497,683	1,954,695,611
2014/11/26	3,974.39	0.54%	3,949	0.53%	-0.01%	497,683	1,965,230,458
2014/11/27	3,890.09	-2.12%	3,865	-2.13%	-0.01%	497,683	1,923,685,159
2014/11/28	3,950.04	1.54%	3,924	1.53%	-0.01%	497,683	1,953,148,360
2014/12/01	3,967.62	0.45%	3,942	0.46%	0.01%	524,230	2,066,286,575
2014/12/02	4,032.75	1.64%	4,006	1.62%	-0.02%	524,230	2,100,013,119
2014/12/03	3,965.97	-1.66%	3,940	-1.65%	0.01%	524,230	2,065,333,976
2014/12/04	3,931.10	-0.88%	3,905	-0.89%	-0.01%	550,776	2,150,871,225

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12月8日)、交換受付日(平成26年12月8日)分の交換口数は以下のとおりです。

交換口数 : 1,770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12月8日)、設定受付日(平成26年12月8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	500
2	2438	アスカネット	100
3	2468	フュートレック	200
4	2492	インフォマート	800
5	3622	ネットイヤーグループ	100
6	3778	さくらインターネット	100
7	3788	GMOクラウド	100
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	200
15	9419	ワイヤレスゲート	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12月4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)

456,691,189 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

15,063 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)

-0.21 %

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

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。

<http://www.simplexasset.com/etf.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場合があります。

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12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12月限 行使価格	26 単位 18,375 円

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12月4日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

790,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

21,661,758,176 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

27,420 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)

-0.48 %

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

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。

<http://www.simplexasset.com/etf.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12月限	3,007 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)

『 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12月4日

- 1 . 上場 E T F の 上場 受益 権 口 数
(開示 基準 日 現在)

1,536,000 口

- 2 . 上場 E T F の 純 資 産 総 額
(開示 基準 日 現在)

7,410,754,209 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)

4,825 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)

0.24 %

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

5 . 連動 対 象 指 標 の 特 徴 と 留 意 点

T O P I X イ ン パ 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 (%) * 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 パ ー ス (- 1 倍) 指 数 に つ い て は、 以 下 の H P を ご 覧 く だ さ い。

<http://www.simplexasset.com/etf.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 パ 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 満 と な る 場 合 が あ り ま す。

・ T O P I X イ ン パ 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 パ 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 な り ま す の で 留 意 が 必 要 で す。 ま た、 イ ン パ 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 パ 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12月限	514 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12月4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)

1,218,605,215 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

15,233 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 %

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

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。

<http://www.simplexasset.com/etf.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12月限

293 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12月4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)

1,090,962,563 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

12,122 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)

-0.06 %

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

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。

<http://www.simplexasset.com/etf.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12月限

120 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12月4日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

1,010,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

14,673,286,751 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

14,528 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)

-0.42 %

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

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。

<http://www.simplexasset.com/etf.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12月限	1,640 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12月4日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

1,162,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

8,204,438,480 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

7,061 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)

0.21 %

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

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。

<http://www.simplexasset.com/etf.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12月限	459 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)

『TOPIX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12月4日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

1,140,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

7,404,361,337 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

6,495 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)

0.47 %

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

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。

<http://www.simplexasset.com/etf.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12月限	1,028 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:1360)
問合せ先 業務本部 山口 節一
(TEL:03-5208-5211)

『日経平均ベア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12月4日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

150,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

1,313,920,237 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

8,759 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)

0.41 %

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

5. 連動対象指標の特徴と留意点

日経平均ダブルインバース・インデックスは、日経平均株価(以下、「日経平均」といいます。)とは2倍の逆(マイナス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。

<http://www.simplexasset.com/etf.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

・日経平均ダブルインバース・インデックスは、変動率が日経平均の日々の変動率の2倍の逆(-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倍以上又は未満となる場合があります。

・日経平均ダブルインバース・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ダブルインバース・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、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2倍上場投信

開示基準日における日経225先物取引の売建玉 14年12月限	147 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