

【表紙】

【提出書類】	臨時報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年10月7日提出
【ファンド名】	日経カバードコール指数上場投信
【発行者名】	シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 水嶋 浩雅
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目 5 番 1 号
【事務連絡者氏名】	山口 節一
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目 5 番 1 号
【電話番号】	03-5208-5211
【縦覧に供する場所】	株式会社東京証券取引所 東京都中央区日本橋兜町 2 番 1 号

1【提出理由】

「日経カバードコール指数上場投信」（以下、当ETFといいます。）におきまして、繰上償還および繰上償還に伴う重大な約款変更を行うべく手続きを開始することを決定しましたので、金融商品取引法第24条の5第4項および特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令第29条第2項第14号の規定に基づき、本臨時報告書を提出するものです。

2【報告内容】

イ 繰上償還の年月日

< 繰上償還 >

平成29年1月17日（予定）

< 繰上償還に伴う重大な約款変更 >

平成29年1月11日（予定）

繰上償還および繰上償還に伴う重大な約款変更に関する書面決議は、賛成の意思表示をされた受益者（約款の規定に基づき、議決権を行使されず賛成とみなされた方を含みます。）が保有する平成28年10月25日現在の受益権口数が、平成28年10月25日現在の受益権総口数の3分の2以上であった場合に可決されます。

ロ 繰上償還にかかる決定に至った理由

< 繰上償還 >

当ETFは、平成23年12月21日に純資産総額が10億円で設定され、平成23年12月22日に東京証券取引所に上場いたしました。設定来、当ETFの「運用の基本方針」に則り、当ETFの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して運用を行って参りましたが、残念ながら、平成28年8月31日の純資産総額は約1億53百万円となっております。

弊社では、当ETFの純資産総額が減少していることから、当ETFは「運用の基本方針」に規定された対象指標への連動性を維持した運用の継続が困難な状況にあると考え、当ETFを繰上償還することが受益者にとって有利と判断いたしました。

< 繰上償還に伴う重大な約款変更 >

- ・無期限としていた信託期間を変更し平成29年1月17日までとします。
- ・繰上償還に伴い償還金支払に関する規定に所要の変更を行います。

ハ 繰上償還に関する情報の受益者への提供または公衆縦覧

書面決議を行うため、平成28年10月25日現在の当ETFの受益者名簿上の受益者に対して、繰上償還および繰上償還に伴う重大な約款変更に関する情報を記載した書面を交付します。

なお、シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社のホームページ（<http://www.simplexasset.com/>）に繰上償還および繰上償還に伴う重大な約款変更に関するお知らせを掲載します。