

平成25年3月28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25年3月27日の状況をご報告します。

上場ETF銘柄(9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	大証
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	大証
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

* 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25年3月27日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

834,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

4,734,972,932 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

5,677 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. 上場ETFの終値と一口あたりの純資産額の乖離率
(開示基準日現在)

-0.65 %

$$\text{乖離率} = \left(\frac{\text{上場ETFの終値}}{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}} - 1 \right) \times 100 (\%)$$

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25年3月27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)

1,451,622,042 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)

13,318 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25年3月27日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

421,553 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

1,470,818,725 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

3,489 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. 上場ETFの終値と一口あたりの純資産額の乖離率
(開示基準日現在)

6.76 %

$$\text{乖離率} = \left[\frac{\text{上場ETFの終値}}{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}} - 1 \right] \times 100 (\%)$$

6. 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
2013/01/24	1,932.21	-0.26%	1,933	-0.26%	0.00%	421,553	815,020,078
2013/01/25	2,063.36	6.79%	2,063	6.73%	-0.06%	421,553	869,818,100
2013/01/28	2,119.99	2.74%	2,119	2.71%	-0.03%	421,553	893,446,185
2013/01/29	1,989.70	-6.15%	1,993	-5.95%	0.20%	421,553	840,030,056
2013/01/30	1,968.80	-1.05%	1,972	-1.05%	0.00%	421,553	831,281,704
2013/01/31	1,958.34	-0.53%	1,962	-0.51%	0.02%	421,553	826,901,481
2013/02/01	1,970.65	0.63%	1,974	0.61%	-0.02%	421,553	832,034,324
2013/02/04	1,896.84	-3.75%	1,900	-3.75%	0.00%	421,553	801,148,589
2013/02/05	1,969.55	3.83%	1,973	3.84%	0.01%	421,553	831,523,808
2013/02/06	1,993.17	1.20%	1,996	1.17%	-0.03%	421,553	841,591,582
2013/02/07	2,000.80	0.38%	2,004	0.40%	0.02%	421,553	844,771,206
2013/02/08	1,988.09	-0.64%	1,991	-0.65%	-0.01%	421,553	839,445,785
2013/02/12	2,035.53	2.39%	2,038	2.36%	-0.03%	421,553	859,220,493
2013/02/13	2,008.49	-1.33%	2,011	-1.32%	0.00%	421,553	847,909,861
2013/02/14	2,046.48	1.89%	2,049	1.89%	0.00%	421,553	863,773,394
2013/02/15	2,235.37	9.23%	2,236	9.13%	-0.10%	421,553	942,717,195
2013/02/18	2,454.95	9.82%	2,454	9.75%	-0.07%	421,553	1,034,444,804
2013/02/19	2,574.29	4.86%	2,572	4.81%	-0.05%	421,553	1,084,304,602
2013/02/20	2,761.52	7.27%	2,758	7.23%	-0.04%	421,553	1,162,534,673
2013/02/21	2,587.46	-6.30%	2,585	-6.27%	0.03%	421,553	1,089,773,596
2013/02/22	2,662.03	2.88%	2,659	2.86%	-0.02%	421,553	1,120,921,587
2013/02/25	2,646.80	-0.57%	2,644	-0.56%	0.01%	421,553	1,114,508,862
2013/02/26	2,616.75	-1.14%	2,614	-1.13%	0.00%	421,553	1,101,934,491
2013/02/27	2,633.69	0.65%	2,631	0.65%	0.00%	421,553	1,108,995,303
2013/02/28	2,719.36	3.25%	2,716	3.23%	-0.02%	421,553	1,144,784,011
2013/03/01	2,980.80	9.61%	2,975	9.54%	-0.08%	421,553	1,254,030,196
2013/03/04	2,977.44	-0.11%	2,971	-0.13%	-0.02%	421,553	1,252,566,817
2013/03/05	3,248.83	9.11%	3,240	9.05%	-0.06%	421,553	1,365,969,422
2013/03/06	3,313.15	1.98%	3,304	1.98%	0.00%	421,553	1,392,829,363
2013/03/07	3,475.35	4.90%	3,465	4.87%	-0.02%	421,553	1,460,596,913
2013/03/08	3,339.83	-3.90%	3,330	-3.90%	0.00%	421,553	1,403,938,470
2013/03/11	3,419.43	2.38%	3,409	2.37%	-0.01%	421,553	1,437,141,220
2013/03/12	3,294.11	-3.66%	3,285	-3.64%	0.03%	421,553	1,384,746,122
2013/03/13	3,268.68	-0.77%	3,260	-0.76%	0.01%	421,553	1,374,099,789
2013/03/14	3,469.27	6.14%	3,458	6.07%	-0.06%	421,553	1,457,911,613
2013/03/15	3,493.19	0.69%	3,482	0.69%	0.00%	421,553	1,467,886,210
2013/03/18	3,478.27	-0.43%	3,467	-0.43%	0.00%	421,553	1,461,584,452
2013/03/19	3,515.05	1.06%	3,504	1.07%	0.01%	421,553	1,476,934,995
2013/03/21	3,866.09	9.99%	3,851	9.90%	-0.08%	421,553	1,623,594,540
2013/03/22	3,799.71	-1.72%	3,786	-1.69%	0.03%	421,553	1,595,828,205
2013/03/25	3,697.45	-2.69%	3,684	-2.69%	0.00%	421,553	1,553,018,708
2013/03/26	3,595.30	-2.76%	3,583	-2.74%	0.02%	421,553	1,510,301,403
2013/03/27	3,493.59	-2.83%	3,489	-2.62%	0.21%	421,553	1,470,818,725

JASDAQ-TOP20上場投信(交換に係わる交換口数)

※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)

※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25年3月27日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

204,212 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

262,874,958 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

1,287 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)

0.24 %

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

5. 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
2013/01/22	1,039.09	0.19%	1,044	0.19%	0.00%	204,212	213,137,555
2013/01/23	1,036.35	-0.26%	1,041	-0.29%	-0.02%	204,212	212,580,009
2013/01/24	1,060.14	2.30%	1,064	2.21%	-0.09%	204,212	217,366,871
2013/01/25	1,059.71	-0.04%	1,064	0.00%	0.04%	204,212	217,274,268
2013/01/28	1,084.05	2.30%	1,088	2.26%	-0.04%	204,212	222,161,067
2013/01/29	1,046.11	-3.50%	1,050	-3.49%	0.01%	204,212	214,510,601
2013/01/30	1,055.06	0.86%	1,059	0.86%	0.00%	204,212	216,309,037
2013/01/31	1,062.05	0.66%	1,066	0.66%	0.00%	204,212	217,710,649
2013/02/01	1,077.01	1.41%	1,081	1.41%	0.00%	204,212	220,718,043
2013/02/04	1,077.90	0.08%	1,082	0.09%	0.01%	204,212	220,880,271
2013/02/05	1,070.54	-0.68%	1,075	-0.65%	0.04%	204,212	219,472,121
2013/02/06	1,081.01	0.98%	1,085	0.93%	-0.05%	204,212	221,574,293
2013/02/07	1,073.22	-0.72%	1,077	-0.74%	-0.02%	204,212	219,999,834
2013/02/08	1,063.65	-0.89%	1,068	-0.84%	0.06%	204,212	218,065,797
2013/02/12	1,036.50	-2.55%	1,041	-2.53%	0.02%	204,212	212,574,188
2013/02/13	1,010.53	-2.51%	1,015	-2.50%	0.01%	204,212	207,335,651
2013/02/14	1,014.07	0.35%	1,019	0.39%	0.04%	204,212	208,042,983
2013/02/15	990.58	-2.32%	996	-2.26%	0.06%	204,212	203,306,707
2013/02/18	1,001.17	1.07%	1,006	1.00%	-0.07%	204,212	205,422,724
2013/02/19	1,019.45	1.83%	1,024	1.79%	-0.04%	204,212	209,099,882
2013/02/20	1,032.13	1.24%	1,036	1.17%	-0.07%	204,212	211,648,592
2013/02/21	1,049.61	1.69%	1,054	1.74%	0.04%	204,212	215,164,467
2013/02/22	1,058.97	0.89%	1,063	0.85%	-0.04%	204,212	217,043,496
2013/02/25	1,086.98	2.65%	1,090	2.54%	-0.11%	204,212	222,668,080
2013/02/26	1,074.85	-1.12%	1,079	-1.01%	0.11%	204,212	220,374,409
2013/02/27	1,088.98	1.31%	1,093	1.30%	-0.02%	204,212	223,214,367
2013/02/28	1,086.12	-0.26%	1,090	-0.27%	-0.01%	204,212	222,631,887
2013/03/01	1,116.86	2.83%	1,121	2.84%	0.01%	204,212	228,819,816
2013/03/04	1,145.61	2.57%	1,149	2.50%	-0.08%	204,212	234,592,677
2013/03/05	1,154.26	0.76%	1,157	0.70%	-0.06%	204,212	236,328,845
2013/03/06	1,191.99	3.27%	1,194	3.20%	-0.07%	204,212	243,923,991
2013/03/07	1,181.40	-0.89%	1,184	-0.84%	0.05%	204,212	241,785,035
2013/03/08	1,173.15	-0.70%	1,176	-0.68%	0.02%	204,212	240,117,309
2013/03/11	1,143.79	-2.50%	1,147	-2.47%	0.04%	204,212	234,184,215
2013/03/12	1,121.14	-1.98%	1,124	-2.01%	-0.02%	204,212	229,614,988
2013/03/13	1,142.07	1.87%	1,145	1.87%	0.00%	204,212	233,825,023
2013/03/14	1,185.46	3.80%	1,188	3.76%	-0.04%	204,212	242,561,001
2013/03/15	1,181.09	-0.37%	1,183	-0.42%	-0.05%	204,212	241,674,462
2013/03/18	1,179.37	-0.15%	1,182	-0.08%	0.06%	204,212	241,308,892
2013/03/19	1,205.84	2.24%	1,208	2.20%	-0.04%	204,212	246,634,772
2013/03/21	1,239.81	2.82%	1,241	2.73%	-0.09%	204,212	253,466,623
2013/03/22	1,216.98	-1.84%	1,219	-1.77%	0.07%	204,212	248,859,675
2013/03/25	1,278.53	5.06%	1,279	4.92%	-0.14%	204,212	261,240,272
2013/03/26	1,265.97	-0.98%	1,267	-0.94%	0.04%	204,212	258,704,018
2013/03/27	1,282.90	1.34%	1,287	1.58%	0.24%	204,212	262,874,958

マザーズ・コア上場投信(交換に係わる交換口数)

※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)

※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25年3月27日

1. 上場 E T F の上場受益権口数
(開示基準日現在)

100,000 口

2. 上場 E T F の純資産総額
(開示基準日現在)

1,326,138,991 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)

13,261 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)

0.64 %

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

5. 交換にかかる有価証券のポートフォリオ (別紙参照)

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/jp/etf/top/unitport.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

	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
2013/01/18	10,158.64	2.10%	11,463	2.04%	-0.06%	100,000	1,146,268,698
2013/01/21	10,059.24	-0.98%	11,351	-0.98%	0.00%	100,000	1,135,102,988
2013/01/22	10,045.29	-0.14%	11,335	-0.14%	0.00%	100,000	1,133,513,236
2013/01/23	9,865.49	-1.79%	11,135	-1.76%	0.03%	100,000	1,113,451,858
2013/01/24	9,978.37	1.14%	11,258	1.10%	-0.04%	100,000	1,125,835,216
2013/01/25	10,218.28	2.40%	11,442	1.63%	-0.77%	100,000	1,144,191,203
2013/01/28	10,148.28	-0.69%	11,364	-0.68%	0.00%	100,000	1,136,408,756
2013/01/29	10,185.39	0.37%	11,405	0.36%	0.00%	100,000	1,140,526,198
2013/01/30	10,361.69	1.73%	11,598	1.69%	-0.04%	100,000	1,159,797,184
2013/01/31	10,403.79	0.41%	11,644	0.40%	-0.01%	100,000	1,164,406,311
2013/02/01	10,429.85	0.25%	11,672	0.24%	-0.01%	100,000	1,167,244,173
2013/02/04	10,485.42	0.53%	11,733	0.52%	-0.01%	100,000	1,173,297,692
2013/02/05	10,359.78	-1.20%	11,594	-1.18%	0.01%	100,000	1,159,407,436
2013/02/06	10,582.79	2.15%	11,839	2.11%	-0.04%	100,000	1,183,893,369
2013/02/07	10,538.83	-0.42%	11,791	-0.41%	0.01%	100,000	1,179,055,769
2013/02/08	10,502.19	-0.35%	11,752	-0.33%	0.02%	100,000	1,175,202,235
2013/02/12	10,678.48	1.68%	11,947	1.66%	-0.02%	100,000	1,194,720,310
2013/02/13	10,600.07	-0.73%	11,858	-0.74%	-0.01%	100,000	1,185,848,164
2013/02/14	10,657.78	0.54%	11,924	0.56%	0.01%	100,000	1,192,424,941
2013/02/15	10,548.33	-1.03%	11,803	-1.01%	0.01%	100,000	1,180,305,625
2013/02/18	10,738.92	1.81%	12,011	1.76%	-0.04%	100,000	1,201,118,568
2013/02/19	10,714.72	-0.23%	11,982	-0.24%	-0.02%	100,000	1,198,248,734
2013/02/20	10,800.93	0.80%	12,075	0.78%	-0.03%	100,000	1,207,482,129
2013/02/21	10,676.60	-1.15%	11,937	-1.14%	0.01%	100,000	1,193,689,797
2013/02/22	10,732.35	0.52%	11,999	0.52%	0.00%	100,000	1,199,872,853
2013/02/25	10,961.37	2.13%	12,250	2.09%	-0.04%	100,000	1,225,014,567
2013/02/26	10,772.04	-1.73%	12,048	-1.65%	0.08%	100,000	1,204,825,998
2013/02/27	10,649.90	-1.13%	11,912	-1.13%	0.01%	100,000	1,191,230,503
2013/02/28	10,926.14	2.59%	12,217	2.56%	-0.03%	100,000	1,221,718,391
2013/03/01	10,973.56	0.43%	12,267	0.41%	-0.02%	100,000	1,226,720,267
2013/03/04	11,022.77	0.45%	12,324	0.46%	0.02%	100,000	1,232,377,706
2013/03/05	11,063.69	0.37%	12,373	0.40%	0.03%	100,000	1,237,281,038
2013/03/06	11,264.50	1.82%	12,592	1.77%	-0.05%	100,000	1,259,207,502
2013/03/07	11,316.46	0.46%	12,648	0.44%	-0.02%	100,000	1,264,799,270
2013/03/08	11,574.59	2.28%	12,932	2.25%	-0.04%	100,000	1,293,219,763
2013/03/11	11,632.33	0.50%	12,995	0.49%	-0.01%	100,000	1,299,464,886
2013/03/12	11,623.50	-0.08%	12,984	-0.08%	-0.01%	100,000	1,298,364,909
2013/03/13	11,589.91	-0.29%	12,946	-0.29%	0.00%	100,000	1,294,608,146
2013/03/14	11,691.70	0.88%	13,057	0.86%	-0.02%	100,000	1,305,709,835
2013/03/15	11,830.02	1.18%	13,208	1.16%	-0.03%	100,000	1,320,845,773
2013/03/18	11,581.28	-2.10%	12,932	-2.09%	0.01%	100,000	1,293,240,171
2013/03/19	11,770.09	1.63%	13,138	1.59%	-0.04%	100,000	1,313,788,278
2013/03/21	11,882.32	0.95%	13,261	0.94%	-0.02%	100,000	1,326,051,723
2013/03/22	11,670.05	-1.79%	13,025	-1.78%	0.01%	100,000	1,302,515,680
2013/03/25	11,835.28	1.42%	13,206	1.39%	-0.03%	100,000	1,320,566,907
2013/03/26	11,816.32	-0.16%	13,190	-0.12%	0.04%	100,000	1,318,974,139
2013/03/27	11,804.06	-0.10%	13,261	0.54%	0.64%	100,000	1,326,138,991

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25年3月28日)、交換受付日(平成25年3月28日)分の交換口数は以下のとおりです。

交換口数 : 10,000口

日経カバードコール指数上場投信(交換ポートフォリオ)

交換有価証券

	発行者	配分比率(%) (※注1)	配分額面(円)	(参考)	(参考)
				総保有数量(円)	ISINコード
1	スウェーデン輸出信用銀行	100.00	98,000,000	984,000,000	XS0799545867

※注1 「配分比率」は、交換有価証券の時価合計を100%とした各有価証券の配分比率。

「ISINコード」とは、国際証券コード仕様ISO6166で定められている全世界共通の証券系コード。各国一機関のみが自国のISINコードの付番権限を付与されています。

交換ポートフォリオの組入れ有価証券の参考情報(※) 1

※当該有価証券の主要な条件のみを要約して参考情報として記載するものであり、条件の全てを網羅しているものでないことをご留意下さい。

全ての組入れ有価証券の時価 : 1,320,232,800 円
(開示基準日における組入れ有価証券の時価)

有価証券1

発行体名 スウェーデン輸出信用銀行
 保有数量 984,000,000 円(額面)
 発行日 2012年7月3日
 満期日 2013年7月23日
 額面金額 1,000,000 円
 クーポン 第1回利金額(1額面金額当たり)= プレミアム2 + 配当1
 第2回利金額(1額面金額当たり)= プレミアム3
 第3回利金額(1額面金額当たり)= プレミアム4
 第4回利金額(1額面金額当たり)= プレミアム5
 第5回利金額(1額面金額当たり)= プレミアム6 + 配当2

プレミアム1 =
 { 投資単位 (0) × オプション (0) }
 + { 投資単位 (1) × オプション (1) }
 + { 投資単位 (2) × オプション (2) }
 + { 投資単位 (3) × オプション (3) }

プレミアム2 =
 { 投資単位 (4) × オプション (4) }
 + { 投資単位 (5) × オプション (5) }
 + { 投資単位 (6) × オプション (6) }

プレミアム3 =
 { 投資単位 (7) × オプション (7) }
 + { 投資単位 (8) × オプション (8) }
 + { 投資単位 (9) × オプション (9) }

$$\begin{aligned} \text{プレミアム4} = & \\ & \{ \text{投資単位 (10)} \times \text{オプション (10)} \} \\ & + \{ \text{投資単位 (11)} \times \text{オプション (11)} \} \\ & + \{ \text{投資単位 (12)} \times \text{オプション (12)} \} \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} \text{プレミアム5} = & \\ & \{ \text{投資単位 (13)} \times \text{オプション (13)} \} \\ & + \{ \text{投資単位 (14)} \times \text{オプション (14)} \} \\ & + \{ \text{投資単位 (15)} \times \text{オプション (15)} \} \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} \text{プレミアム6} = & \\ & \{ \text{投資単位 (16)} \times \text{オプション (16)} \} \\ & + \{ \text{投資単位 (17)} \times \text{オプション (17)} \} \\ & + \{ \text{投資単位 (18)} \times \text{オプション (18)} \} \end{aligned}$$

$$\text{投資単位 (i)} = \text{投資金額 (i)} / (\text{日経平均 (i)} - \text{オプション (i)})$$

「日経平均 (i)」は観測日iの日経平均終値、「オプション (i)」は日経カバードコール指数算出に用いられている直近限月のコール・オプションの観測日 (i)における終値を意味しています。

観測日(i)の(i)について

i = 0	2011年12月9日
1	2012年1月13日
2	2012年2月10日
3	2012年3月9日
4	2012年4月13日
5	2012年5月11日
6	2012年6月8日
7	2012年7月13日
8	2012年8月10日
9	2012年9月14日
10	2012年10月12日
11	2012年11月9日
12	2012年12月14日
13	2013年1月11日
14	2013年2月8日
15	2013年3月8日
16	2013年4月12日
17	2013年5月10日
18	2013年6月14日
19	2013年7月12日

また、「投資金額 (i)」は以下の算式によります。

$$\text{投資金額 (0)} = 1,000,000$$

$$\text{投資金額 (1)} = \text{投資金額 (0)} \times \text{NKYCC (1)} / \text{NKYCC (0)}$$

$$\text{投資金額 (2)} = \text{投資金額 (1)} \times \text{NKYCC (2)} / \text{NKYCC (1)}$$

$$\text{投資金額 (3)} = \text{投資金額 (2)} \times \text{NKYCC (3)} / \text{NKYCC (2)}$$

$$\text{投資金額 (4)} = \text{投資金額 (3)} \times \text{NKYCC (4)} / \text{NKYCC (3)} - \text{プレミアム1}$$

$$\text{投資金額 (5)} = \text{投資金額 (4)} \times \text{NKYCC (5)} / \text{NKYCC (4)}$$

$$\text{投資金額 (6)} = \text{投資金額 (5)} \times \text{NKYCC (6)} / \text{NKYCC (5)}$$

$$\text{投資金額 (7)} = \text{投資金額 (6)} \times \text{NKYCC (7)} / \text{NKYCC (6)} - \text{プレミアム2}$$

$$\text{投資金額 (8)} = \text{投資金額 (7)} \times \text{NKYCC (8)} / \text{NKYCC (7)}$$

$$\text{投資金額 (9)} = \text{投資金額 (8)} \times \text{NKYCC (9)} / \text{NKYCC (8)}$$

$$\text{投資金額 (10)} = \text{投資金額 (9)} \times \text{NKYCC (10)} / \text{NKYCC (9)} - \text{プレミアム3}$$

$$\begin{aligned} \text{投資金額 (11)} &= \text{投資金額 (10)} \times \text{NKYCC (11)} / \text{NKYCC (10)} \\ \text{投資金額 (12)} &= \text{投資金額 (11)} \times \text{NKYCC (12)} / \text{NKYCC (11)} \\ \text{投資金額 (13)} &= \text{投資金額 (12)} \times \text{NKYCC (13)} / \text{NKYCC (12)} - \text{プレミアム4} \\ \text{投資金額 (14)} &= \text{投資金額 (13)} \times \text{NKYCC (14)} / \text{NKYCC (13)} \\ \text{投資金額 (15)} &= \text{投資金額 (14)} \times \text{NKYCC (15)} / \text{NKYCC (14)} \\ \text{投資金額 (16)} &= \text{投資金額 (15)} \times \text{NKYCC (16)} / \text{NKYCC (15)} - \text{プレミアム5} \\ \text{投資金額 (17)} &= \text{投資金額 (16)} \times \text{NKYCC (17)} / \text{NKYCC (16)} \\ \text{投資金額 (18)} &= \text{投資金額 (17)} \times \text{NKYCC (18)} / \text{NKYCC (17)} \\ \text{投資金額 (19)} &= \text{投資金額 (18)} \times \text{NKYCC (19)} / \text{NKYCC (18)} - \text{プレミアム6} \end{aligned}$$

ここで、「NKYCC (i)」は、観測日*i*の日経カバードコール指数終値を意味しています。

配当1 =

$$\begin{aligned} &\{ \text{投資単位 (0)} \times \text{配当金額 (1)} \} \\ &+ \{ \text{投資単位 (1)} \times \text{配当金額 (2)} \} \\ &+ \{ \text{投資単位 (2)} \times \text{配当金額 (3)} \} \\ &+ \{ \text{投資単位 (3)} \times \text{配当金額 (4)} \} \\ &+ \{ \text{投資単位 (4)} \times \text{配当金額 (5)} \} \\ &+ \{ \text{投資単位 (5)} \times \text{配当金額 (6)} \} \\ &+ \{ \text{投資単位 (6)} \times \text{配当金額 (7)} \} \end{aligned}$$

配当2 =

$$\begin{aligned} &\{ \text{投資単位 (7)} \times \text{配当金額 (8)} \} \\ &+ \{ \text{投資単位 (8)} \times \text{配当金額 (9)} \} \\ &+ \{ \text{投資単位 (9)} \times \text{配当金額 (10)} \} \\ &+ \{ \text{投資単位 (10)} \times \text{配当金額 (11)} \} \\ &+ \{ \text{投資単位 (11)} \times \text{配当金額 (12)} \} \\ &+ \{ \text{投資単位 (12)} \times \text{配当金額 (13)} \} \\ &+ \{ \text{投資単位 (13)} \times \text{配当金額 (14)} \} \\ &+ \{ \text{投資単位 (14)} \times \text{配当金額 (15)} \} \\ &+ \{ \text{投資単位 (15)} \times \text{配当金額 (16)} \} \\ &+ \{ \text{投資単位 (16)} \times \text{配当金額 (17)} \} \\ &+ \{ \text{投資単位 (17)} \times \text{配当金額 (18)} \} \\ &+ \{ \text{投資単位 (18)} \times \text{配当金額 (19)} \} \end{aligned}$$

ここで、「配当金額 (i)」は、概念的には、日経平均採用銘柄の各々について、観測日*i-1* から観測日*i* の間に、日経カバードコール指数の想定するカバードコール戦略のもとで投資金額(i)当たり保有すべき株数を保有していれば受け取ったであろう配当金の合計金額であって、実際には、このような概念に基づいて予め規定されたルールに則って算定された金額です。

利金支払日	第1回利払日	2012年7月23日
	第2回利払日	2012年10月23日
	第3回利払日	2013年1月23日
	第4回利払日	2013年4月23日
	第5回利払日	2013年7月23日
償還金額	投資金額 (19) (1額面金額当たり)	

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25年3月27日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

1,030,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

16,195,653,425 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

15,724 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)

2.60 %

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

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/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

・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。

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 13年06月限	3,086 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25年3月27日

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

890,000 口

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

6,654,682,926 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)

7,477 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)

-1.30 %

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

5 . 連動 対 象 指 標 の 特 徴 と 留 意 点

T O P I X イ ン バ 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 バ 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/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

・ T O P I X イ ン バ 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 バ 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 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 バ 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 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ペア上場投信

開示基準日におけるTOPIX先物取引の売建玉 13年06月限	633 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25年3月27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)

681,146,695 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

11,352 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)

-0.36 %

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

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。)
13年04月限 207 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: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25年3月27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)

567,327,524 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

11,347 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)

0.12 %

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

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用です。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。

以上

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。)
13年04月限 83 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