

平成25年7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 5 年 7 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25年7月25日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

334,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

2,178,884,147 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

6,524 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)

0.11 %

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

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25年7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)

1,639,840,254 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)

15,044 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-TOP20上場投信』に関する日々の開示事項

開示基準日:平成25年7月25日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

552,575 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

3,633,626,409 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

6,576 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)

0.00 %

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

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
2013/05/28	8,123.36	11.71%	8,078	11.70%	-0.01%	721,473	5,827,757,922
2013/05/29	7,831.67	-3.59%	7,788	-3.59%	0.00%	721,473	5,618,676,961
2013/05/30	7,454.15	-4.82%	7,413	-4.82%	0.01%	721,473	5,348,111,520
2013/05/31	8,277.98	11.05%	8,231	11.03%	-0.02%	721,473	5,938,238,631
2013/06/03	8,029.95	-3.00%	7,984	-3.00%	0.00%	721,473	5,760,230,588
2013/06/04	7,863.52	-2.07%	7,819	-2.07%	0.01%	721,473	5,640,898,793
2013/06/05	7,697.20	-2.12%	7,653	-2.12%	-0.01%	721,473	5,521,640,977
2013/06/06	6,880.21	-10.61%	6,842	-10.60%	0.02%	721,473	4,936,221,170
2013/06/07	6,375.76	-7.33%	6,341	-7.32%	0.01%	721,473	4,574,731,213
2013/06/10	7,247.78	13.68%	7,206	13.64%	-0.04%	721,473	5,199,237,788
2013/06/11	7,897.84	8.97%	7,852	8.96%	0.00%	721,473	5,664,879,412
2013/06/12	7,981.01	1.05%	7,934	1.04%	-0.01%	721,473	5,724,361,199
2013/06/13	7,758.86	-2.78%	7,714	-2.77%	0.01%	721,473	5,565,105,986
2013/06/14	7,641.12	-1.52%	7,596	-1.53%	-0.01%	721,473	5,480,661,451
2013/06/17	7,858.80	2.85%	7,812	2.84%	-0.01%	721,473	5,636,328,616
2013/06/18	7,948.75	1.14%	7,901	1.14%	-0.01%	721,473	5,700,670,883
2013/06/19	7,727.65	-2.78%	7,682	-2.77%	0.01%	721,473	5,542,172,071
2013/06/20	7,833.98	1.38%	7,787	1.37%	-0.01%	721,473	5,618,247,161
2013/06/21	7,831.87	-0.03%	7,785	-0.03%	0.00%	721,473	5,616,632,972
2013/06/24	7,832.87	0.01%	7,786	0.01%	0.00%	721,473	5,617,046,495
2013/06/25	7,660.07	-2.21%	7,614	-2.21%	0.00%	721,473	5,493,140,329
2013/06/26	6,272.45	-18.11%	6,236	-18.10%	0.02%	721,473	4,499,260,249
2013/06/27	6,490.68	3.48%	6,453	3.48%	0.00%	721,473	4,655,515,696
2013/06/28	7,064.07	8.83%	7,022	8.82%	-0.02%	721,473	5,066,216,168
2013/07/01	7,949.55	12.53%	7,901	12.52%	-0.02%	721,473	5,700,307,900
2013/07/02	7,909.25	-0.51%	7,861	-0.51%	0.00%	721,473	5,671,200,666
2013/07/03	7,728.26	-2.29%	7,681	-2.29%	0.00%	721,473	5,541,361,261
2013/07/04	7,471.06	-3.33%	7,425	-3.33%	0.00%	721,473	5,356,892,542
2013/07/05	7,635.44	2.20%	7,588	2.20%	0.00%	721,473	5,474,624,430
2013/07/08	7,376.77	-3.39%	7,331	-3.39%	0.00%	721,473	5,288,903,632
2013/07/09	6,840.79	-7.27%	6,798	-7.27%	0.00%	552,575	3,756,396,752
2013/07/10	6,914.37	1.08%	6,871	1.07%	0.00%	552,575	3,796,730,898
2013/07/11	6,835.72	-1.14%	6,793	-1.14%	0.00%	552,575	3,753,497,691
2013/07/12	6,854.26	0.27%	6,811	0.26%	-0.01%	552,575	3,763,477,610
2013/07/16	6,759.90	-1.38%	6,717	-1.38%	0.00%	552,575	3,711,620,387
2013/07/17	6,417.07	-5.07%	6,377	-5.06%	0.01%	552,575	3,523,614,779
2013/07/18	6,854.39	6.81%	6,810	6.79%	-0.02%	552,575	3,763,061,437
2013/07/19	6,666.71	-2.74%	6,624	-2.73%	0.01%	552,575	3,660,217,457
2013/07/22	6,677.78	0.17%	6,635	0.17%	0.00%	552,575	3,666,113,839
2013/07/23	6,620.80	-0.85%	6,578	-0.86%	-0.01%	552,575	3,634,854,842
2013/07/24	6,596.57	-0.37%	6,554	-0.36%	0.00%	552,575	3,621,532,382
2013/07/25	6,618.76	0.34%	6,576	0.34%	0.00%	552,575	3,633,626,409

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7月25日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

858,218 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

1,475,337,455 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

1,719 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)

-0.33 %

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

5. 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
2013/05/23	1,665.21	-8.19%	1,663	-8.17%	0.02%	858,218	1,427,344,044
2013/05/24	1,707.50	2.54%	1,705	2.53%	-0.01%	858,218	1,463,450,953
2013/05/27	1,641.02	-3.89%	1,639	-3.87%	0.02%	858,218	1,406,552,985
2013/05/28	1,669.71	1.75%	1,667	1.71%	-0.04%	858,218	1,431,035,676
2013/05/29	1,731.82	3.72%	1,729	3.72%	0.00%	858,218	1,484,079,717
2013/05/30	1,651.49	-4.64%	1,649	-4.63%	0.01%	858,218	1,415,406,357
2013/05/31	1,671.74	1.23%	1,669	1.21%	-0.01%	858,218	1,432,682,656
2013/06/03	1,672.79	0.06%	1,670	0.06%	0.00%	858,218	1,433,488,578
2013/06/04	1,681.10	0.50%	1,679	0.54%	0.04%	858,218	1,440,560,189
2013/06/05	1,661.70	-1.15%	1,659	-1.19%	-0.04%	858,218	1,423,961,657
2013/06/06	1,485.10	-10.63%	1,483	-10.61%	0.02%	858,218	1,273,023,030
2013/06/07	1,398.79	-5.81%	1,397	-5.80%	0.01%	858,218	1,199,251,369
2013/06/10	1,563.88	11.80%	1,562	11.81%	0.01%	858,218	1,340,249,468
2013/06/11	1,566.22	0.15%	1,564	0.13%	-0.02%	858,218	1,342,220,576
2013/06/12	1,584.44	1.16%	1,582	1.15%	-0.01%	858,218	1,357,762,448
2013/06/13	1,513.66	-4.47%	1,512	-4.42%	0.04%	858,218	1,297,244,437
2013/06/14	1,519.07	0.36%	1,517	0.33%	-0.03%	858,218	1,301,846,332
2013/06/17	1,532.43	0.88%	1,530	0.86%	-0.02%	858,218	1,313,179,548
2013/06/18	1,543.82	0.74%	1,541	0.72%	-0.02%	858,218	1,322,883,352
2013/06/19	1,500.18	-2.83%	1,498	-2.79%	0.04%	858,218	1,285,562,578
2013/06/20	1,523.93	1.58%	1,522	1.60%	0.02%	858,218	1,305,838,156
2013/06/21	1,507.31	-1.09%	1,505	-1.12%	-0.03%	858,218	1,291,607,763
2013/06/24	1,491.25	-1.07%	1,489	-1.06%	0.00%	858,218	1,277,794,809
2013/06/25	1,472.91	-1.23%	1,471	-1.21%	0.02%	858,218	1,262,092,130
2013/06/26	1,372.32	-6.83%	1,373	-6.66%	0.17%	858,218	1,178,600,962
2013/06/27	1,415.10	3.12%	1,416	3.13%	0.01%	858,218	1,215,131,614
2013/06/28	1,492.96	5.50%	1,493	5.44%	-0.06%	858,218	1,281,643,581
2013/07/01	1,546.45	3.58%	1,547	3.62%	0.03%	858,218	1,327,268,317
2013/07/02	1,555.37	0.58%	1,555	0.52%	-0.06%	858,218	1,334,866,539
2013/07/03	1,570.45	0.97%	1,570	0.96%	0.00%	858,218	1,347,724,610
2013/07/04	1,575.44	0.32%	1,575	0.32%	0.00%	858,218	1,351,956,047
2013/07/05	1,619.02	2.77%	1,619	2.79%	0.03%	858,218	1,389,167,608
2013/07/08	1,591.69	-1.69%	1,585	-2.10%	-0.41%	858,218	1,360,613,973
2013/07/09	1,598.28	0.41%	1,592	0.44%	0.03%	858,218	1,366,201,223
2013/07/10	1,563.87	-2.15%	1,558	-2.14%	0.02%	858,218	1,336,823,361
2013/07/11	1,602.71	2.48%	1,596	2.44%	-0.04%	858,218	1,369,921,117
2013/07/12	1,603.57	0.05%	1,597	0.06%	0.01%	858,218	1,370,625,676
2013/07/16	1,623.45	1.24%	1,617	1.25%	0.01%	858,218	1,387,362,148
2013/07/17	1,676.94	3.29%	1,670	3.28%	-0.02%	858,218	1,432,953,842
2013/07/18	1,690.73	0.82%	1,683	0.78%	-0.04%	858,218	1,444,682,076
2013/07/19	1,621.42	-4.10%	1,614	-4.10%	0.00%	858,218	1,385,535,061
2013/07/22	1,651.58	1.86%	1,644	1.86%	0.00%	858,218	1,411,170,169
2013/07/23	1,662.97	0.69%	1,656	0.73%	0.04%	858,218	1,420,852,105
2013/07/24	1,692.27	1.76%	1,690	2.05%	0.29%	858,218	1,450,011,338
2013/07/25	1,726.92	2.05%	1,719	1.72%	-0.33%	858,218	1,475,337,455

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7月25日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

100,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

1,260,238,382 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

12,602 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)

-6.85 %

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

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
2013/05/21	13,277.40	0.17%	14,476	0.17%	-0.01%	100,000	1,447,643,626
2013/05/22	13,319.05	0.31%	14,521	0.31%	0.00%	100,000	1,452,051,640
2013/05/23	12,717.12	-4.52%	13,876	-4.44%	0.08%	100,000	1,387,579,595
2013/05/24	12,855.35	1.09%	14,023	1.06%	-0.03%	100,000	1,402,320,422
2013/05/27	12,625.85	-1.79%	13,777	-1.75%	0.03%	100,000	1,377,662,304
2013/05/28	12,715.32	0.71%	13,872	0.69%	-0.02%	100,000	1,387,188,065
2013/05/29	12,777.90	0.49%	13,937	0.47%	-0.02%	100,000	1,393,663,297
2013/05/30	12,190.25	-4.60%	13,308	-4.51%	0.09%	100,000	1,330,766,441
2013/05/31	12,357.34	1.37%	13,487	1.35%	-0.03%	100,000	1,348,656,837
2013/06/03	11,931.56	-3.45%	13,028	-3.40%	0.04%	100,000	1,302,844,898
2013/06/04	12,160.29	1.92%	13,272	1.87%	-0.04%	100,000	1,327,230,095
2013/06/05	11,716.34	-3.65%	12,797	-3.58%	0.07%	100,000	1,279,684,539
2013/06/06	11,619.20	-0.83%	12,693	-0.81%	0.02%	100,000	1,269,334,828
2013/06/07	11,595.34	-0.21%	12,667	-0.20%	0.00%	100,000	1,266,660,456
2013/06/10	12,166.09	4.92%	13,276	4.81%	-0.11%	100,000	1,327,615,848
2013/06/11	11,994.43	-1.41%	13,092	-1.39%	0.03%	100,000	1,309,196,688
2013/06/12	11,968.94	-0.21%	13,064	-0.21%	0.00%	100,000	1,306,423,377
2013/06/13	11,208.79	-6.35%	12,251	-6.22%	0.13%	100,000	1,225,126,904
2013/06/14	11,426.89	1.95%	12,483	1.89%	-0.05%	100,000	1,248,332,329
2013/06/17	11,668.71	2.12%	12,745	2.10%	-0.02%	100,000	1,274,454,862
2013/06/18	11,681.80	0.11%	12,757	0.09%	-0.02%	100,000	1,275,716,420
2013/06/19	11,781.58	0.85%	12,863	0.83%	-0.02%	100,000	1,286,325,962
2013/06/20	11,711.66	-0.59%	12,787	-0.59%	0.00%	100,000	1,278,731,412
2013/06/21	11,758.39	0.40%	12,837	0.39%	-0.01%	100,000	1,283,732,166
2013/06/24	11,783.95	0.22%	12,863	0.20%	-0.01%	100,000	1,286,335,821
2013/06/25	11,725.31	-0.50%	12,800	-0.49%	0.01%	100,000	1,280,020,471
2013/06/26	11,688.03	-0.32%	12,770	-0.23%	0.08%	100,000	1,276,952,407
2013/06/27	11,863.24	1.50%	12,956	1.46%	-0.04%	100,000	1,295,630,786
2013/06/28	12,093.20	1.94%	13,201	1.89%	-0.05%	100,000	1,320,114,510
2013/07/01	12,102.61	0.08%	13,210	0.07%	-0.01%	100,000	1,321,043,889
2013/07/02	12,140.73	0.31%	13,251	0.31%	0.00%	100,000	1,325,060,085
2013/07/03	12,193.25	0.43%	13,301	0.38%	-0.06%	100,000	1,330,060,212
2013/07/04	12,173.26	-0.16%	13,280	-0.16%	0.01%	100,000	1,327,975,471
2013/07/05	12,238.93	0.54%	13,349	0.52%	-0.02%	100,000	1,334,943,559
2013/07/08	12,145.91	-0.76%	13,249	-0.75%	0.01%	100,000	1,324,851,537
2013/07/09	12,417.27	2.23%	13,538	2.18%	-0.05%	100,000	1,353,762,867
2013/07/10	12,309.76	-0.87%	13,422	-0.86%	0.01%	100,000	1,342,231,406
2013/07/11	12,232.09	-0.63%	13,338	-0.63%	0.01%	100,000	1,333,794,501
2013/07/12	12,329.36	0.80%	13,438	0.75%	-0.05%	100,000	1,343,802,633
2013/07/16	12,378.94	0.40%	13,486	0.36%	-0.04%	100,000	1,348,556,722
2013/07/17	12,401.15	0.18%	13,506	0.15%	-0.03%	100,000	1,350,642,730
2013/07/18	12,506.92	0.85%	13,610	0.77%	-0.08%	100,000	1,361,023,310
2013/07/19	12,371.05	-1.09%	13,471	-1.02%	0.07%	100,000	1,347,138,950
2013/07/22	12,442.27	0.58%	13,544	0.54%	-0.03%	100,000	1,354,387,692
2013/07/23	12,549.76	0.86%	13,651	0.79%	-0.07%	100,000	1,365,122,375
2013/07/24	12,543.57	-0.05%	13,645	-0.04%	0.01%	100,000	1,364,484,774
2013/07/25	12,443.89	-0.79%	12,602	-7.64%	-6.85%	100,000	1,260,238,382

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7月26日)、交換受付日(平成25年7月26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	ゴールドマン・サックス・ インターナショナル	100.00	123,000,000	1,238,000,000	XS0839365334

※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 : 1,253,475,000 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 ゴールドマン・サックス・インターナショナル
保有数量 1,238,000,000 円(額面)
発行日 2013年7月9日
満期日 2014年1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1 + 配当1
第2回利金額(1額面金額当たり)=プレミアム2
第3回利金額(1額面金額当たり)=プレミアム3 + 配当2

プレミアム1 = 59,190.14

プレミアム2 =
{ 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3 =
{ 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) }

投資単位 (i) = 投資金額 (i) / (日経平均 (i) - 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の観測日(i)の(i)について

i = 0 2013年6月14日

- 1 2013年7月12日
- 2 2013年8月9日
- 3 2013年9月13日
- 4 2013年10月11日
- 5 2013年11月8日
- 6 2013年12月13日
- 7 2014年1月10日

また、「投資金額 (i)」は以下の算式によります。

$$\text{投資金額 (0)} = 982,676.52$$

$$\text{投資金額 (1)} = \text{投資金額 (0)} \times \text{NKYCC (1)} / \text{NKYCC (0)} - \text{プレミアム1}$$

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

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

$$\text{投資金額 (4)} = \text{投資金額 (3)} \times \text{NKYCC (4)} / \text{NKYCC (3)} - \text{プレミアム2}$$

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

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

$$\text{投資金額 (7)} = \text{投資金額 (6)} \times \text{NKYCC (7)} / \text{NKYCC (6)} - \text{プレミアム3}$$

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

配当1 =

17,323.48

$$+ \{ \text{投資単位 (0)} \times \text{配当金額 (1)} \}$$

配当2 =

{ 投資単位 (1) × 配当金額 (2) }

+ { 投資単位 (2) × 配当金額 (3) }

+ { 投資単位 (3) × 配当金額 (4) }

+ { 投資単位 (4) × 配当金額 (5) }

+ { 投資単位 (5) × 配当金額 (6) }

+ { 投資単位 (6) × 配当金額 (7) }

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

利金支払日	第1回利払日	2013年7月23日
	第2回利払日	2013年10月23日
	第3回利払日	2014年1月23日

償還金額 投資金額 (7) (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7月25日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

1,290,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

25,265,325,308 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

19,586 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)

-1.05 %

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

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。

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09月限	4,225 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: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25年7月25日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

1,210,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

7,620,893,249 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

6,298 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)

0.52 %

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

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。

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 13年09月限	635 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7月25日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

40,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

398,699,035 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

9,967 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)

0.05 %

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

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07月限

126 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25年7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)

638,641,862 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

12,773 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07月限

101 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25年7月25日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

750,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

7,487,834,930 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

9,984 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)

-0.57 %

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

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 13年09月限	1,034 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25年7月25日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

160,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

1,515,193,421 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

9,470 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)

0.27 %

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

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 13年09月限	104 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