

令和5年7月4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：03-6843-1413)

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、以下のとおり令和5年7月3日の状況をご報告します。

上場ETF銘柄(17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 | 東証スタンダード TOP20 ETF | 1551 | 東証 |
| 4 | 東証グロース・コア ETF | 1563 | 東証 |
| 5 | TOPIXブル2倍上場投信 | 1568 | 東証 |
| 6 | TOPIXベア上場投信 | 1569 | 東証 |
| 7 | 中国H株ブル2倍上場投信 | 1572 | 東証 |
| 8 | 中国H株ベア上場投信 | 1573 | 東証 |
| 9 | 日経平均ブル2倍上場投信 | 1579 | 東証 |
| 10 | 日経平均ベア上場投信 | 1580 | 東証 |
| 11 | TOPIXベア2倍上場投信 | 1356 | 東証 |
| 12 | 日経平均ベア2倍上場投信 | 1360 | 東証 |
| 13 | JPX日経400ベア2倍上場投信(ダブルインバース) | 1469 | 東証 |
| 14 | 東証マザーズETF | 2516 | 東証 |
| 15 | 東証REIT ETF | 2555 | 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:03-6843-1413)

『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:令和5年7月3日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

10,793,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

26,937,877,409 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

2,495.87 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 %

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

5. 指標の特徴や留意点等

○原資産等の価格を利用する指標との差異
対象指標は、現物の原油価格ではなく、原油先物取引の価格を参照しています。原油先物取引の価格には、保管コスト（コスト・オブ・キャリー）等が反映されることにより、現物の原油価格を参照する場合と比べて投資成果が下回るおそれがあります。

○ロールオーバーに伴う損益について
対象指標を構成する原油先物取引において、通常、限月間に保管コスト等を反映した価格差があります。期近の先物価格よりも期先の先物価格が高くなっていく順踏の状態（以下「コンタンゴ」といいます。）において、保管コスト等を反映した先物価格の時間的価値が減価する場合には、次限月以降の限月への乗換え（以下「ロールオーバー」といいます。）に伴って損失が発生する場合があります。一方、期近の先物価格よりも期先の先物価格が低くなっていく逆踏の状態（「バックワーデーション」といいます。）においては、ロールオーバーに伴って収益が発生する場合があります。

○留意すべき投資スタイル（中長期的な投資）
コンタンゴの状態が多くなる場合等、ロールオーバーに伴う損失が累積すること等によって対象指標が減価するおそれがあるため、中長期的な投資を行う場合には留意が必要です。

○原油先物取引が限月の最終取引日近くとなり、銘柄入れ替えを行う際に負担する売買コストが、基準価額の変動率との乖離を生じさせる要因になる可能性があります。

○信託報酬等のコスト負担が、基準価額の変動率との乖離を生じさせる要因になります。

以上

WTI原油価格連動型上場投信

開示基準日におけるWTI原油先物取引の買建玉

23年09月限

2,343 単位

23年10月限

271 単位

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
(銘柄コード:1679)
問合せ先 業務本部 山口 節一
(TEL:03-6843-1413)

『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:令和5年7月3日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

31,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

1,311,785,284 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

42,315.65 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 %

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

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:03-6843-1413)

『東証スタンダードTOP20 ETF』に関する日々の開示事項

開示基準日:令和5年7月3日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

147,981 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

679,960,538 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

4,594.92 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

東証スタンダードTOP20 ETF

| | 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 |
|------------|----------|-----------|----------------|-----------|--------|---------|-------------|
| 2023/04/21 | 995.96 | -0.04% | 4,391 | -0.04% | 0.00% | 147,981 | 649,828,798 |
| 2023/04/24 | 993.05 | -0.29% | 4,378 | -0.30% | -0.01% | 147,981 | 647,879,311 |
| 2023/04/25 | 996.34 | 0.33% | 4,392 | 0.33% | 0.00% | 147,981 | 649,995,584 |
| 2023/04/26 | 985.74 | -1.06% | 4,346 | -1.06% | 0.00% | 147,981 | 643,103,385 |
| 2023/04/27 | 987.83 | 0.21% | 4,355 | 0.21% | 0.00% | 147,981 | 644,437,685 |
| 2023/04/28 | 1,000.97 | 1.33% | 4,413 | 1.32% | -0.01% | 147,981 | 652,974,235 |
| 2023/05/01 | 1,005.71 | 0.47% | 4,434 | 0.50% | 0.02% | 147,981 | 656,206,418 |
| 2023/05/02 | 1,006.16 | 0.04% | 4,436 | 0.04% | 0.00% | 147,981 | 656,480,362 |
| 2023/05/08 | 1,012.03 | 0.58% | 4,461 | 0.56% | -0.02% | 147,981 | 660,157,259 |
| 2023/05/09 | 1,016.17 | 0.41% | 4,479 | 0.40% | 0.00% | 147,981 | 662,829,410 |
| 2023/05/10 | 1,011.65 | -0.44% | 4,460 | -0.43% | 0.01% | 147,981 | 659,972,581 |
| 2023/05/11 | 1,010.00 | -0.16% | 4,452 | -0.17% | 0.00% | 147,981 | 658,864,033 |
| 2023/05/12 | 1,012.91 | 0.29% | 4,459 | 0.15% | -0.14% | 147,981 | 659,846,029 |
| 2023/05/15 | 1,027.46 | 1.44% | 4,528 | 1.55% | 0.12% | 147,981 | 670,089,628 |
| 2023/05/16 | 1,032.39 | 0.48% | 4,550 | 0.48% | 0.00% | 147,981 | 673,313,797 |
| 2023/05/17 | 1,029.23 | -0.31% | 4,536 | -0.31% | 0.00% | 147,981 | 671,249,057 |
| 2023/05/18 | 1,024.46 | -0.46% | 4,515 | -0.46% | 0.00% | 147,981 | 668,129,353 |
| 2023/05/19 | 1,028.23 | 0.37% | 4,531 | 0.36% | -0.01% | 147,981 | 670,553,670 |
| 2023/05/22 | 1,032.94 | 0.46% | 4,551 | 0.44% | -0.02% | 147,981 | 673,488,598 |
| 2023/05/23 | 1,027.58 | -0.52% | 4,527 | -0.52% | 0.00% | 147,981 | 669,981,397 |
| 2023/05/24 | 1,020.44 | -0.69% | 4,496 | -0.70% | 0.00% | 147,981 | 665,305,302 |
| 2023/05/25 | 1,015.99 | -0.44% | 4,476 | -0.44% | 0.00% | 147,981 | 662,373,996 |
| 2023/05/26 | 1,012.33 | -0.36% | 4,460 | -0.36% | 0.00% | 147,981 | 659,964,728 |
| 2023/05/29 | 1,014.03 | 0.17% | 4,466 | 0.15% | -0.02% | 147,981 | 660,947,168 |
| 2023/05/30 | 1,010.46 | -0.35% | 4,455 | -0.26% | 0.09% | 147,981 | 659,244,704 |
| 2023/05/31 | 1,008.54 | -0.19% | 4,446 | -0.20% | -0.01% | 147,981 | 657,951,828 |
| 2023/06/01 | 1,007.78 | -0.08% | 4,443 | -0.08% | 0.00% | 147,981 | 657,425,701 |
| 2023/06/02 | 1,015.61 | 0.78% | 4,477 | 0.77% | -0.01% | 147,981 | 662,477,210 |
| 2023/06/05 | 1,021.60 | 0.59% | 4,502 | 0.57% | -0.02% | 147,981 | 666,244,491 |
| 2023/06/06 | 1,022.89 | 0.13% | 4,508 | 0.12% | -0.01% | 147,981 | 667,040,010 |
| 2023/06/07 | 1,014.06 | -0.86% | 4,469 | -0.86% | 0.00% | 147,981 | 661,282,381 |
| 2023/06/08 | 1,003.02 | -1.09% | 4,420 | -1.09% | 0.00% | 147,981 | 654,083,596 |
| 2023/06/09 | 1,011.37 | 0.83% | 4,456 | 0.82% | -0.01% | 147,981 | 659,451,900 |
| 2023/06/12 | 1,015.70 | 0.43% | 4,475 | 0.41% | -0.02% | 147,981 | 662,147,132 |
| 2023/06/13 | 1,022.48 | 0.67% | 4,504 | 0.66% | -0.01% | 147,981 | 666,503,495 |
| 2023/06/14 | 1,023.16 | 0.07% | 4,507 | 0.06% | -0.01% | 147,981 | 666,908,630 |
| 2023/06/15 | 1,021.82 | -0.13% | 4,501 | -0.14% | -0.01% | 147,981 | 665,997,599 |
| 2023/06/16 | 1,031.33 | 0.93% | 4,542 | 0.92% | -0.01% | 147,981 | 672,137,581 |
| 2023/06/19 | 1,035.22 | 0.38% | 4,558 | 0.36% | -0.02% | 147,981 | 674,539,165 |
| 2023/06/20 | 1,036.63 | 0.14% | 4,564 | 0.13% | 0.00% | 147,981 | 675,433,171 |
| 2023/06/21 | 1,039.88 | 0.31% | 4,578 | 0.31% | 0.00% | 147,981 | 677,522,927 |
| 2023/06/22 | 1,040.12 | 0.02% | 4,579 | 0.02% | 0.00% | 147,981 | 677,676,714 |
| 2023/06/23 | 1,037.38 | -0.26% | 4,567 | -0.27% | 0.00% | 147,981 | 675,878,096 |
| 2023/06/26 | 1,032.65 | -0.46% | 4,546 | -0.47% | -0.01% | 147,981 | 672,720,055 |
| 2023/06/27 | 1,028.76 | -0.38% | 4,529 | -0.38% | 0.00% | 147,981 | 670,183,323 |
| 2023/06/28 | 1,040.23 | 1.11% | 4,579 | 1.11% | -0.01% | 147,981 | 677,609,263 |
| 2023/06/29 | 1,040.47 | 0.02% | 4,582 | 0.07% | 0.05% | 147,981 | 678,117,408 |

東証スタンダードTOP20 ETF(交換に係わる交換口数)

※令和05年7月5日は交換不可日のため、受け付けておりません

東証スタンダードTOP20 ETF(設定ポートフォリオ)

※令和05年7月5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:03-6843-1413)

『東証グロース・コア ETF』に関する日々の開示事項

開示基準日:令和5年7月3日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

1,053,480 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

2,860,422,462 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

2,715.21 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)

以 上

東証グロース・コア ETF

| 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 |
|------------|----------|-----------|----------------|-----------|--------|-----------|---------------|
| 2023/04/21 | 917.67 | -2.21% | 2,467 | -2.20% | 0.01% | 849,630 | 2,095,651,257 |
| 2023/04/24 | 919.59 | 0.21% | 2,472 | 0.21% | 0.00% | 849,630 | 2,100,005,550 |
| 2023/04/25 | 914.99 | -0.50% | 2,459 | -0.50% | 0.00% | 849,630 | 2,089,492,659 |
| 2023/04/26 | 893.03 | -2.40% | 2,400 | -2.40% | 0.00% | 849,630 | 2,039,418,871 |
| 2023/04/27 | 892.35 | -0.08% | 2,399 | -0.08% | 0.00% | 849,630 | 2,037,862,114 |
| 2023/04/28 | 905.35 | 1.46% | 2,433 | 1.45% | 0.00% | 849,630 | 2,067,489,940 |
| 2023/05/01 | 884.09 | -2.35% | 2,376 | -2.35% | 0.00% | 849,630 | 2,018,900,571 |
| 2023/05/02 | 893.15 | 1.02% | 2,400 | 1.02% | 0.00% | 849,630 | 2,039,502,974 |
| 2023/05/08 | 910.69 | 1.96% | 2,448 | 1.96% | 0.00% | 849,630 | 2,079,499,873 |
| 2023/05/09 | 917.70 | 0.77% | 2,466 | 0.77% | 0.00% | 849,630 | 2,095,503,500 |
| 2023/05/10 | 907.63 | -1.10% | 2,439 | -1.09% | 0.00% | 849,630 | 2,072,576,228 |
| 2023/05/11 | 915.47 | 0.86% | 2,460 | 0.86% | 0.00% | 849,630 | 2,090,409,220 |
| 2023/05/12 | 912.85 | -0.29% | 2,453 | -0.28% | 0.00% | 849,630 | 2,084,511,396 |
| 2023/05/15 | 923.02 | 1.11% | 2,481 | 1.12% | 0.00% | 849,630 | 2,107,763,163 |
| 2023/05/16 | 929.39 | 0.69% | 2,498 | 0.69% | 0.00% | 849,630 | 2,122,221,463 |
| 2023/05/17 | 931.05 | 0.18% | 2,502 | 0.18% | 0.00% | 849,630 | 2,125,942,160 |
| 2023/05/18 | 929.37 | -0.18% | 2,498 | -0.18% | 0.00% | 849,630 | 2,122,070,221 |
| 2023/05/19 | 932.99 | 0.39% | 2,507 | 0.39% | 0.00% | 849,630 | 2,130,316,623 |
| 2023/05/22 | 936.52 | 0.38% | 2,517 | 0.37% | -0.01% | 849,630 | 2,138,261,147 |
| 2023/05/23 | 930.83 | -0.61% | 2,501 | -0.61% | 0.00% | 849,630 | 2,125,244,740 |
| 2023/05/24 | 927.14 | -0.40% | 2,491 | -0.40% | 0.00% | 849,630 | 2,116,835,038 |
| 2023/05/25 | 921.40 | -0.62% | 2,476 | -0.62% | 0.00% | 849,630 | 2,103,768,133 |
| 2023/05/26 | 908.25 | -1.43% | 2,441 | -1.43% | 0.00% | 849,630 | 2,073,774,019 |
| 2023/05/29 | 912.66 | 0.49% | 2,453 | 0.48% | 0.00% | 849,630 | 2,083,777,853 |
| 2023/05/30 | 939.43 | 2.93% | 2,524 | 2.93% | -0.01% | 849,630 | 2,144,742,509 |
| 2023/05/31 | 954.30 | 1.58% | 2,564 | 1.58% | -0.01% | 849,630 | 2,178,558,918 |
| 2023/06/01 | 950.66 | -0.38% | 2,554 | -0.38% | 0.00% | 849,630 | 2,170,245,375 |
| 2023/06/02 | 971.52 | 2.19% | 2,610 | 2.19% | -0.01% | 849,630 | 2,217,745,617 |
| 2023/06/05 | 989.42 | 1.84% | 2,658 | 1.84% | -0.01% | 849,630 | 2,258,472,689 |
| 2023/06/06 | 997.86 | 0.85% | 2,681 | 0.85% | 0.00% | 849,630 | 2,277,632,171 |
| 2023/06/07 | 1,004.53 | 0.67% | 2,699 | 0.67% | 0.00% | 849,630 | 2,292,774,109 |
| 2023/06/08 | 976.02 | -2.84% | 2,622 | -2.83% | 0.01% | 849,630 | 2,227,872,697 |
| 2023/06/09 | 980.66 | 0.48% | 2,635 | 0.48% | 0.00% | 849,630 | 2,238,457,372 |
| 2023/06/12 | 1,014.01 | 3.40% | 2,724 | 3.39% | -0.01% | 849,630 | 2,314,347,710 |
| 2023/06/13 | 1,031.96 | 1.77% | 2,772 | 1.77% | 0.00% | 849,630 | 2,355,258,917 |
| 2023/06/14 | 1,040.07 | 0.79% | 2,794 | 0.79% | 0.00% | 917,584 | 2,563,646,186 |
| 2023/06/15 | 1,039.08 | -0.10% | 2,791 | -0.10% | 0.00% | 917,584 | 2,561,186,175 |
| 2023/06/16 | 1,101.03 | 5.96% | 2,957 | 5.95% | -0.01% | 917,584 | 2,713,615,153 |
| 2023/06/19 | 1,123.55 | 2.05% | 3,018 | 2.04% | -0.01% | 917,584 | 2,768,981,996 |
| 2023/06/20 | 1,131.41 | 0.70% | 3,039 | 0.70% | 0.00% | 985,526 | 2,994,786,256 |
| 2023/06/21 | 1,126.02 | -0.48% | 3,024 | -0.48% | 0.00% | 1,019,499 | 3,083,278,903 |
| 2023/06/22 | 1,104.76 | -1.89% | 2,967 | -1.89% | 0.00% | 1,053,484 | 3,125,987,375 |
| 2023/06/23 | 1,070.76 | -3.08% | 2,876 | -3.08% | 0.00% | 1,053,484 | 3,029,821,249 |
| 2023/06/26 | 1,052.90 | -1.67% | 2,828 | -1.67% | 0.00% | 1,019,503 | 2,883,246,148 |
| 2023/06/27 | 1,006.68 | -4.39% | 2,704 | -4.38% | 0.00% | 1,019,503 | 2,756,813,422 |
| 2023/06/28 | 993.49 | -1.31% | 2,669 | -1.31% | 0.00% | 1,053,480 | 2,811,363,324 |
| 2023/06/29 | 997.49 | 0.40% | 2,679 | 0.41% | 0.00% | 1,053,480 | 2,822,771,877 |
| 2023/06/30 | 1,001.13 | 0.36% | 2,689 | 0.36% | 0.00% | 1,053,480 | 2,833,040,131 |
| 2023/07/03 | 1,010.82 | 0.97% | 2,715 | 0.97% | 0.00% | 1,053,480 | 2,860,422,462 |

東証グロース・コア ETF(交換に係わる交換口数)

※令和05年7月5日は交換不可日のため、受け付けておりません

東証グロース・コア ETF(設定ポートフォリオ)

※令和05年7月5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:1568)
問合せ先 業務本部 山口 節一
(TEL:03-6843-1413)

『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:令和5年7月3日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

280,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

9,727,222,402 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

34,740.08 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/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)指数は減速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 23年09月限 | 901 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 |

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:03-6843-1413)

『TOPIXベア上場投信』に関する日々の開示事項

開示基準日:令和5年7月3日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

6,606,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

10,870,765,471 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

1,645.59 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)

0.22 %

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

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。

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

・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倍以上又は未満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)指数は減速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ます。留意が必要です。

以上

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 23年09月限 | 469 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:03-6843-1413)

『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:令和5年7月3日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

460,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

2,053,473,297 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

4,464.07 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)

0.29 %

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

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/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。

以上

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。)

23年07月限

720 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:03-6843-1413)

『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:令和5年7月3日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

57,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

654,894,711 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

11,489.38 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/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倍以上又は未満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遜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。)

23年07月限

106 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

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
 (銘柄コード:1579)
 問合せ先 業務本部 山口 節一
 (TEL:03-6843-1413)

『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:令和5年7月3日

1. 上場ETFの上場受益権口数
 (開示基準日現在)

800,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
 (開示基準日現在)

18,296,794,960 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
 (開示基準日現在)

22,870.99 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)

-0.51 %

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

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/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・インデックスは逃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 23年09月限 | 980 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 | 80,000 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:03-6843-1413)

『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:令和5年7月3日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

7,652,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

15,427,184,746 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

2,016.10 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)

0.25 %

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

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(対象指標)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/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

・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倍以上又は未満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ます、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 23年09月限 | 457 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:03-6843-1413)

『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:令和5年7月3日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

8,320,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

4,999,304,394 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

600.88 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)

0.45 %

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

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/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

・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 23年09月限 | 431 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:03-6843-1413)

『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:令和5年7月3日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

119,150,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

64,266,082,896 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

539.37 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)

0.50 %

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

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(対象指標)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。

※日経平均ダブルインバース・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/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

- ・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・インデックスは通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 23年09月限 | 3,779 単位 |
|-----------------------------------|----------|

| | |
|-------------------|-------------|
| 開示基準日における追加申込 | 960,000 口 |
| 開示基準日における換金(解約)請求 | 1,800,000 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:1469)
問合せ先 業務本部 山口 節一
(TEL:03-6843-1413)

『JPX日経400ベア 2倍上場投信 (ダブルインバース) 』に関する日々の開示事項

開示基準日:令和5年7月3日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

348,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

377,886,346 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

1,085.88 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)

0.50 %

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

5. 連動対象指標の特徴と留意点

JPX日経400ダブルインバース・インデックス (対象指数) は、下記の計算式を用いて原指標であるJPX日経インデックス400 (配当なし) (以下、「JPX日経400」といいます。) 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 × JPX日経400の前日比変動率)

※JPX日経400ダブルインバース・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/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

・JPX日経400ダブルインバース・インデックスは、変動率がJPX日経400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JPX日経400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、JPX日経400の変動率の-2倍以上又は未満となる場合があります。

・JPX日経400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、JPX日経400の動きと逆に下落していく傾向があります。また、JPX日経400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JPX日経400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ます。留意が必要です。

以 上

JPX日経400ペア2倍上場投信(ダブルインバース)

| | |
|--------------------------------------|--------|
| 開示基準日におけるJPX日経400先物取引の売建玉 23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:2516)
問合せ先 業務本部 山口 節一
(TEL:03-6843-1413)

『東証マザーズETF』に関する日々の開示事項

開示基準日:令和5年7月3日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

27,410,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

17,476,762,802 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

637.61 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 %

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

以 上

東証マザーズETF

開示基準日における東証マザーズ指数先物取引の買建玉
23年09月限 20,004 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:2555)
問合せ先 業務本部 山口 節一
(TEL:03-6843-1413)

『東証REIT ETF』に関する日々の開示事項

開示基準日:令和5年7月3日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

26,607,959 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

51,323,032,940 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

1,928.86 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)

東証 REIT ETF(交換に係わる交換口数)

※交換申込日(令和05年7月5日)、交換受付日(令和05年7月5日)分の交換口数は以下のとおりです。

交換口数 : 概算 150,000口

東証 REIT ETF(設定ポートフォリオ)

※設定申込日(令和05年7月5日)、設定受付日(令和05年7月5日)分の設定ポートフォリオは以下のとおりです。

| No. | 銘柄コード | 銘柄名 | 株式数 |
|-----|-------|------------|-----|
| 1 | 29710 | R-エスコンジャパン | 5 |
| 2 | 29720 | R-サンケイRE | 9 |
| 3 | 29790 | R-SOSiLA物流 | 13 |
| 4 | 29890 | R-東海道リート | 4 |
| 5 | 32260 | R-アコモF | 9 |
| 6 | 32340 | R-森ヒルズ | 32 |
| 7 | 32490 | R-産業ファ | 41 |
| 8 | 32690 | R-ADR | 27 |
| 9 | 32780 | R-ケネディレジ | 20 |
| 10 | 32790 | R-API | 14 |
| 11 | 32810 | R-GLP | 91 |
| 12 | 32820 | R-コンフォリア | 13 |
| 13 | 32830 | R-プロロジ | 47 |
| 14 | 32870 | R-星野 | 5 |
| 15 | 32900 | R-Oneリート | 5 |
| 16 | 32920 | R-イオンリート | 31 |
| 17 | 32950 | R-ヒューリックRE | 25 |
| 18 | 32960 | R-日本リート | 9 |
| 19 | 33090 | R-積水ハウスリート | 81 |
| 20 | 34510 | R-トーセイ・リート | 6 |
| 21 | 34530 | R-ケネディクス商業 | 12 |
| 22 | 34550 | R-HCM | 7 |
| 23 | 34590 | R-サムティレジ | 7 |
| 24 | 34620 | R-NMF | 87 |
| 25 | 34630 | R-いちごホテル | 4 |
| 26 | 34660 | R-ラサールロジ | 33 |
| 27 | 34680 | R-スターアジア | 34 |
| 28 | 34700 | R-マリモリート | 4 |
| 29 | 34710 | R-三井不ロジパーク | 11 |
| 30 | 34720 | R-大江戸温泉 | 4 |
| 31 | 34760 | R-投資法人みらい | 33 |
| 32 | 34810 | R-三菱地所物流 | 9 |
| 33 | 34870 | R-CREロジ | 11 |
| 34 | 34880 | R-ザイマックス | 4 |
| 35 | 34920 | R-タカラリート | 13 |
| 36 | 34930 | R-ADL | 12 |
| 37 | 89510 | R-ビルF | 31 |
| 38 | 89520 | R-ジャパン | 28 |
| 39 | 89530 | R-都市ファンド | 137 |
| 40 | 89540 | R-オリックスF | 54 |
| 41 | 89550 | R-Jプライム | 18 |
| 42 | 89560 | R-NTT都市開発R | 26 |
| 43 | 89570 | R-東急RE | 18 |
| 44 | 89580 | R-グローバル | 20 |
| 45 | 89600 | R-ユナイテッド | 60 |
| 46 | 89610 | R-森トラスト | 50 |

| No. | 銘柄コード | 銘柄名 | 株式数 |
|-----|-------|------------|-----|
| 47 | 89630 | R-INV | 119 |
| 48 | 89640 | R-フロンティア | 10 |
| 49 | 89660 | R-平和RE | 19 |
| 50 | 89670 | R-ニホンロジ | 18 |
| 51 | 89680 | R-福岡 | 14 |
| 52 | 89720 | R-ケネディオフィス | 16 |
| 53 | 89750 | R-いちごオフィス | 22 |
| 54 | 89760 | R-大和OF | 5 |
| 55 | 89770 | R-阪急阪神 | 12 |
| 56 | 89790 | R-スターツPR | 5 |
| 57 | 89840 | R-ハウスリート | 41 |
| 58 | 89850 | R-JHR | 87 |
| 59 | 89860 | R-大和証券リビング | 37 |
| 60 | 89870 | R-エクセレント | 25 |