

平成 30 年 9 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)

E T F の設定/解約の申込み受付の中止に関するお知らせ

当社が設定、運用する上場 E T F 6 銘柄について、以下のとおり設定・解約の申込み受付を中止いたします。

記

○上場 E T F 銘柄 (6 銘柄)

1568_T O P I X ブル 2 倍 上 場 投 信

1569_T O P I X ベア 上 場 投 信

1356_T O P I X ベア 2 倍 上 場 投 信

1579_日 経 平 均 ブル 2 倍 上 場 投 信

1580_日 経 平 均 ベア 上 場 投 信

1360_日 経 平 均 ベア 2 倍 上 場 投 信

(以下「本 E T F」といいます。)

○設定・解約の受付を中止する理由

本 E T F は、有価証券指数先物取引にて運用を行っておりますが、四半期末日（取引所営業日、以下同じ）の先物取引の清算値は終値ではなく理論価格で算出されます。そのため、四半期末日において、本 E T F の設定または解約が大量に発生すると、ポジション調整後、当該日の基準価額に反映されることになり、受益者および投資家に少なからず影響を与えることとなります。したがって、本 E T F の設定・解約の申込み受付を、四半期末日のみ中止することにより、受益者および投資家への影響がないようにいたします。また、今後につきましては、約款変更を行うことにより、毎四半期末日を申込不可とすることを検討いたします。

○申込み受付中止日

平成 30 年 9 月 28 日（当日約定分）

以上