

平成 30 年 12 月 25 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 12 月 28 日 (当日約定分)

以上