

2022年12月1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)

J P X日経400ベア上場投信（インバース）の
重大な約款変更に関する書面決議基準日設定のお知らせ

当社は、2022年12月1日に「J P X日経400ベア上場投信（インバース）」（証券コー：1468）（以下「本ETF」といいます。）について、「信託契約の解約」の条文の見直しに伴う重大な約款変更を提案し、法令に基づき書面による決議を行うこと、および、2022年12月16日を基準日とし、当該基準日現在の受益者名簿上の受益者を、当該書面決議において議決権を行使できる受益者と定めることを決定しましたので、お知らせいたします。

なお、当該約款変更にかかる書面決議が可決された場合、2023年3月9日に当局への届出を行い、2023年3月10日付で約款変更を実施する予定です。

記

1. 対象ファンド

J P X日経400ベア上場投信（インバース）

2. 繰上償還およびそれに伴う重大な約款変更に関する日程（予定）

書面決議の対象受益者の確定基準日	2022年12月16日（金）
書面決議に関する書類発送日	2023年1月25日（水）
議決権行使書面による議決権行使期限	2023年2月9日（木）
書面決議日	2023年2月13日（月）
買取請求開始日（予定）	2023年2月15日（水）
買取請求終了日（予定）	2023年3月7日（火）
約款変更実施日（予定）	2023年3月10日（金）

3. 約款変更の内容および理由

●内容

- ・「信託契約の解約」の条文の見直しを行い、信託終了の手続きの条件を最低口数とそれを下回る期間の継続を明示することにより明確化する変更を行います。

●理由

- ・本ETFは、設定来、本ETFの「運用の基本方針」に則り、本ETFの基準価額の変動率を対象指標の変動率に一致させることを目指して運用を行って参りましたが、残念ながら、2022年10月31日の純資産総額は約3,006万円（総口数は7千口）となっております。また、本ETFは信託約款第43条第1項に定める「受益権の総口数が10万口を下回る」状況が2022年3月末以降、半年以上経過しており、2020年10月1日から2022年9月30日までの期間の平均受益権口数を見ても、約43,500口と、10万口を大きく下回っています。

当社は、本ETFのコスト面で、受益権口数が僅少であるため、わずかの一部解約請求であってもその一部解約に伴うコストの影響が残存受益者に大きな影響を与えること、本ETFにかかる信託報酬以外の諸費用の負担割合が大きいことから、対象指標への連動性が低下し、対象指標に比べてパフォーマンスも低下することが大いに懸念される状況にあることを鑑みて、信託終了の手続きの条件を最低口数とそれを下回る期間の継続を明示することにより明確化することとします。

4. 書面決議の判定

議案に関する書面決議は、賛成の意思表示をされた受益者（約款の規定に基づき、議決権を行使されず賛成とみなされた方を含みます。）が保有する2022年12月16日現在の受益権口数が、2022年12月16日現在の受益権総口数の3分の2以上であった場合に可決されます。

5. 書面決議に反対された受益者の買取請求手続き

議案に関する書面決議が可決された場合は、書面決議に反対された受益者は2023年2月15日から2023年3月7日までの間に、本ETFの受託会社に対して、2022年12月16日時点で保有する受益権について当該信託財産をもって買取を当社所定の手続きに基づいて請求することができます。

なお、書面決議に反対された受益者が必ず買取請求しなければならないわけではありません。

6. 投資信託約款の変更案

「J P X日経400ベア上場投信（インバース）」

下線部_____は変更部分を示します。

(新)	(旧)
<p>(信託契約の解約)</p> <p>第43条 委託者は、平成29年9月1日以降、受益権の総口数が10万口を下回ることとなった場合、もしくは、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。</p> <p>② 委託者は、<u>令和5年4月10日以降、受益権の総口数が20営業日連続して10万口を下回った場合</u>、第4条の規定により受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止になった場合、対象指標が廃止されたとき、対象指標の公示性または市場性が失われたとき、対象指標に継続性を失わせるような改定が行なわれたとき等で、それに代わる新たな対象指標を定めることができない場合（これらを含めて「廃止された」といいます。）は、受託者と合意のうえ、その廃止された日に、投資信託を終了するための手続きを開始し、この信託契約を解約し信託を終了させます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。</p> <p>③～⑥ <略></p>	<p>(信託契約の解約)</p> <p>第43条 委託者は、平成29年9月1日以降、受益権の総口数が10万口を下回ることとなった場合、もしくは、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。</p> <p>② 委託者は、第4条の規定により受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止になった場合、対象指標が廃止されたとき、対象指標の公示性または市場性が失われたとき、対象指標に継続性を失わせるような改定が行なわれたとき等で、それに代わる新たな対象指標を定めることができない場合（これらを含めて「廃止された」といいます。）は、受託者と合意のうえ、その廃止された日に、投資信託を終了するための手続きを開始し、この信託契約を解約し信託を終了させます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。</p> <p>③～⑥ <略></p>

以上