

令和6年8月7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 ビジネスサポート本部 山口 節一
(TEL：03-6843-1413)

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が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6年8月6日の状況をご報告します。

上場ETF銘柄(19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	東証グロース250ETF	2516	東証
15	東証REIT ETF	2555	東証
16	PBR1倍割れ解消推進ETF	2080	東証
17	政策保有解消推進ETF	2081	東証
18	投資家経営者一心同体ETF	2082	東証
19	東証REITインバース ETF	2094	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 ビジネスサポート本部 山口 節一
(TEL: 03-6843-1413)

『WT I 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6年8月6日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

6, 146, 000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

17, 813, 485, 031 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

2, 898. 39 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. 32 %

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

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軌の状態（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軌の状態（「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かい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かい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

24年10月限

1,611 単位

24年11月限

118 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 ビジネスサポート本部 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6年8月6日

1. 上場E T Fの上場受益権口数
(開示基準日現在)

48,000 口

2. 上場E T Fの純資産総額
(開示基準日現在)

2,251,080,456 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)

46,897.51 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)

0.00 %

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

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 ビジネスサポート本部 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6年8月6日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

116,229 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

538,541,664 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

4,633.45 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)

-0.06 %

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

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
2024/05/27	1,111.87	0.23%	4,915	0.21%	-0.02%	131,454	646,076,472
2024/05/28	1,113.92	0.18%	4,924	0.18%	-0.01%	131,454	647,214,442
2024/05/29	1,103.77	-0.91%	4,879	-0.91%	0.00%	131,454	641,343,767
2024/05/30	1,107.99	0.38%	4,901	0.46%	0.08%	131,454	644,310,130
2024/05/31	1,115.18	0.65%	4,932	0.63%	-0.02%	131,454	648,379,248
2024/06/03	1,129.52	1.29%	4,994	1.25%	-0.03%	131,454	656,490,106
2024/06/04	1,127.68	-0.16%	4,986	-0.17%	0.00%	131,454	655,398,657
2024/06/05	1,111.41	-1.44%	4,915	-1.43%	0.02%	131,454	646,041,190
2024/06/06	1,104.45	-0.63%	4,884	-0.62%	0.00%	131,454	642,005,612
2024/06/07	1,110.00	0.50%	4,908	0.49%	-0.01%	131,454	645,155,436
2024/06/10	1,117.83	0.71%	4,941	0.68%	-0.02%	131,454	649,545,979
2024/06/11	1,114.84	-0.27%	4,928	-0.27%	0.00%	131,454	647,798,737
2024/06/12	1,118.40	0.32%	4,943	0.31%	-0.01%	131,454	649,804,011
2024/06/13	1,107.93	-0.94%	4,897	-0.93%	0.01%	131,454	643,763,448
2024/06/14	1,116.71	0.79%	4,935	0.78%	-0.01%	131,454	648,777,055
2024/06/17	1,099.60	-1.53%	4,860	-1.53%	0.00%	131,454	638,840,396
2024/06/18	1,106.16	0.60%	4,888	0.58%	-0.01%	131,454	642,571,507
2024/06/19	1,108.42	0.20%	4,898	0.20%	-0.01%	131,454	643,832,420
2024/06/20	1,141.40	2.98%	5,042	2.94%	-0.04%	131,454	662,754,251
2024/06/21	1,147.82	0.56%	5,070	0.55%	-0.01%	131,454	666,423,978
2024/06/24	1,149.07	0.11%	5,075	0.10%	-0.01%	131,454	667,097,325
2024/06/25	1,154.64	0.48%	5,099	0.48%	-0.01%	131,454	670,288,130
2024/06/26	1,156.68	0.18%	5,122	0.44%	0.27%	131,454	673,259,193
2024/06/27	1,165.53	0.77%	5,167	0.89%	0.12%	131,454	679,220,091
2024/06/28	1,170.29	0.41%	5,188	0.40%	-0.01%	131,454	681,932,652
2024/07/01	1,166.69	-0.31%	5,172	-0.31%	0.00%	131,454	679,831,786
2024/07/02	1,166.87	0.02%	5,172	0.01%	0.00%	131,454	679,928,371
2024/07/03	1,171.20	0.37%	5,191	0.36%	-0.01%	116,229	603,337,406
2024/07/04	1,176.22	0.43%	5,213	0.42%	-0.01%	116,229	605,857,172
2024/07/05	1,162.33	-1.18%	5,152	-1.16%	0.02%	116,229	598,847,983
2024/07/08	1,157.75	-0.39%	5,076	-1.48%	-1.09%	116,229	589,988,399
2024/07/09	1,160.26	0.22%	5,087	0.21%	0.00%	116,229	591,243,523
2024/07/10	1,163.74	0.30%	5,102	0.30%	0.00%	116,229	592,993,748
2024/07/11	1,175.68	1.03%	5,154	1.01%	-0.01%	116,229	599,006,502
2024/07/12	1,186.97	0.96%	5,203	0.95%	-0.01%	116,229	604,701,833
2024/07/16	1,195.26	0.70%	5,238	0.68%	-0.02%	116,229	608,834,201
2024/07/17	1,191.13	-0.35%	5,220	-0.34%	0.00%	116,229	606,751,637
2024/07/18	1,187.73	-0.29%	5,205	-0.28%	0.00%	116,229	605,028,169
2024/07/19	1,186.37	-0.11%	5,200	-0.11%	0.00%	116,229	604,337,282
2024/07/22	1,173.78	-1.06%	5,145	-1.06%	0.01%	116,229	597,955,061
2024/07/23	1,182.96	0.78%	5,184	0.77%	-0.01%	116,229	602,586,107
2024/07/24	1,175.05	-0.67%	5,150	-0.66%	0.01%	116,229	598,599,702
2024/07/25	1,152.61	-1.91%	5,053	-1.90%	0.01%	116,229	587,246,631
2024/07/26	1,147.27	-0.46%	5,029	-0.46%	0.00%	116,229	584,529,943
2024/07/29	1,158.69	1.00%	5,078	0.98%	-0.01%	116,229	590,267,628
2024/07/30	1,145.78	-1.11%	5,022	-1.11%	0.00%	116,229	583,705,536
2024/07/31	1,172.90	2.37%	5,140	2.35%	-0.02%	116,229	597,405,766

東証スタンダードTOP20 ETF(交換に係わる交換口数)

※交換申込日(令和06年8月8日)、交換受付日(令和06年8月8日)分の交換口数は以下のとおりです。

交換口数: 概算 15,800 口

東証スタンダードTOP20 ETF(設定ポートフォリオ)

※設定申込日(令和06年8月8日)、設定受付日(令和06年8月8日)分の設定ポートフォリオは以下のとおりです。

	コード	銘柄名	株式数
1	2702	マクドナルド	700
2	2782	セリア	1100
3	3222	U. S. M. H	3500
4	3254	プレサンス	2100
5	4716	日本オラクル	400
6	4966	上村工業	400
7	6324	ハーモニック	800
8	6425	ユニバーサル	1500
9	6890	フェローテック	900
10	6960	フクダ電子	900
11	7105	三菱ロジスネクスト	2800
12	7163	住信SBIネット銀	2400
13	7412	アトム	4800
14	7451	三菱食品	1000
15	7564	ワークマン	700
16	7716	ナカニシ	1700
17	8066	三谷商	1800
18	8572	アコム	11100
19	9436	沖縄セルラー	1400

[掲載番号:4]
各 位

令和6年8月7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:1563)
問合せ先 ビジネスサポート本部 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6年8月6日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

1,976,270 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

3,668,804,406 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

1,856.43 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)

-0.07 %

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

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
2024/05/27	766.55	0.64%	2,065	0.64%	0.00%	1,946,056	4,018,977,260
2024/05/28	765.10	-0.19%	2,061	-0.19%	0.00%	1,946,056	4,011,434,017
2024/05/29	744.10	-2.74%	2,005	-2.73%	0.01%	1,946,056	3,901,817,987
2024/05/30	744.22	0.02%	2,005	0.02%	0.00%	1,946,056	3,902,425,782
2024/05/31	770.50	3.53%	2,076	3.51%	-0.02%	1,946,056	4,039,507,819
2024/06/03	772.26	0.23%	2,080	0.23%	0.00%	1,946,056	4,048,751,036
2024/06/04	793.26	2.72%	2,137	2.70%	-0.01%	1,946,056	4,158,252,983
2024/06/05	778.11	-1.91%	2,096	-1.90%	0.01%	1,915,866	4,015,923,252
2024/06/06	766.45	-1.50%	2,065	-1.49%	0.00%	1,915,866	3,955,926,587
2024/06/07	781.36	1.95%	2,105	1.94%	-0.01%	1,915,866	4,032,518,211
2024/06/10	777.82	-0.45%	2,095	-0.45%	0.00%	1,915,866	4,014,335,737
2024/06/11	787.50	1.24%	2,121	1.24%	-0.01%	1,915,866	4,064,035,644
2024/06/12	791.63	0.52%	2,132	0.52%	-0.01%	1,915,866	4,085,091,080
2024/06/13	791.27	-0.05%	2,131	-0.05%	0.00%	1,915,866	4,083,228,937
2024/06/14	780.11	-1.41%	2,101	-1.41%	0.00%	1,915,866	4,025,778,728
2024/06/17	777.44	-0.34%	2,094	-0.34%	0.00%	1,915,866	4,012,110,558
2024/06/18	773.56	-0.50%	2,084	-0.50%	0.00%	1,915,866	3,992,164,570
2024/06/19	768.67	-0.63%	2,071	-0.63%	0.00%	1,915,866	3,967,078,390
2024/06/20	787.96	2.51%	2,122	2.50%	-0.01%	1,915,866	4,066,148,708
2024/06/21	792.58	0.59%	2,135	0.58%	0.00%	1,915,866	4,089,889,894
2024/06/24	786.17	-0.81%	2,118	-0.81%	0.00%	1,915,866	4,056,927,469
2024/06/25	790.58	0.56%	2,129	0.56%	0.00%	1,915,866	4,079,667,853
2024/06/26	810.49	2.52%	2,183	2.50%	-0.02%	2,187,660	4,774,925,456
2024/06/27	818.63	1.00%	2,205	1.01%	0.01%	2,187,660	4,823,208,190
2024/06/28	810.64	-0.98%	2,183	-0.97%	0.00%	2,187,660	4,776,286,729
2024/07/01	796.43	-1.75%	2,145	-1.75%	0.01%	2,187,660	4,692,814,366
2024/07/02	795.13	-0.16%	2,142	-0.16%	0.00%	2,187,660	4,685,189,121
2024/07/03	813.94	2.37%	2,192	2.35%	-0.01%	2,187,660	4,795,498,101
2024/07/04	824.97	1.36%	2,222	1.35%	0.00%	2,187,660	4,860,301,110
2024/07/05	833.77	1.07%	2,245	1.06%	-0.01%	2,187,660	4,911,802,492
2024/07/08	831.99	-0.21%	2,241	-0.21%	0.00%	2,187,660	4,901,542,831
2024/07/09	827.32	-0.56%	2,228	-0.56%	0.00%	2,187,660	4,874,089,347
2024/07/10	824.00	-0.40%	2,219	-0.40%	0.00%	1,825,307	4,050,554,806
2024/07/11	821.32	-0.33%	2,212	-0.32%	0.00%	1,825,307	4,037,468,899
2024/07/12	863.89	5.18%	2,326	5.16%	-0.03%	1,825,307	4,245,717,912
2024/07/16	860.50	-0.39%	2,317	-0.39%	0.00%	1,825,307	4,229,121,527
2024/07/17	876.10	1.81%	2,359	1.81%	-0.01%	1,825,307	4,305,509,980
2024/07/18	858.10	-2.05%	2,311	-2.04%	0.01%	1,885,694	4,357,113,930
2024/07/19	845.21	-1.50%	2,276	-1.50%	0.00%	1,885,694	4,291,839,178
2024/07/22	820.90	-2.88%	2,211	-2.86%	0.01%	1,885,694	4,168,925,399
2024/07/23	831.12	1.24%	2,238	1.24%	-0.01%	1,885,694	4,220,568,785
2024/07/24	818.76	-1.49%	2,205	-1.48%	0.01%	1,885,694	4,158,028,926
2024/07/25	817.17	-0.19%	2,201	-0.19%	0.00%	1,885,694	4,149,935,085
2024/07/26	824.10	0.85%	2,219	0.85%	0.00%	1,885,694	4,185,018,655
2024/07/29	844.34	2.46%	2,274	2.45%	-0.01%	1,976,270	4,493,315,541
2024/07/30	832.53	-1.40%	2,242	-1.39%	0.01%	1,976,270	4,430,801,171
2024/07/31	824.58	-0.95%	2,221	-0.95%	0.00%	1,976,270	4,388,660,547
2024/08/01	788.55	-4.37%	2,124	-4.35%	0.02%	1,976,270	4,197,738,942
2024/08/02	721.91	-8.45%	1,945	-8.41%	0.04%	1,976,270	3,844,613,897
2024/08/05	612.51	-15.15%	1,652	-15.08%	0.07%	1,976,270	3,264,764,224
2024/08/06	688.76	12.45%	1,856	12.38%	-0.07%	1,976,270	3,668,804,406

東証グロース・コア ETF(交換に係わる交換口数)

※交換申込日(令和06年8月8日)、交換受付日(令和06年8月8日)分の交換口数は以下のとおりです。

交換口数: 概算 30,800 口

東証グロース・コア ETF(設定ポートフォリオ)

※設定申込日(令和06年8月8日)、設定受付日(令和06年8月8日)分の設定ポートフォリオは以下のとおりです。

	コード	銘柄名	株式数
1	2160	G-GNI	3800
2	3479	G-TKP	1400
3	4051	G-GMO-FG	400
4	4194	ビジョナル	600
5	4375	G-セーフィー	2600
6	4477	G-BASE	9200
7	4478	G-フリー	900
8	4485	G-JTOWER	600
9	5253	G-カバー	1500
10	6027	G-弁護士ドットコム	900
11	6030	G-アドベンチャー	300
12	7095	MacbeeP	800
13	7157	G-ライフネット	3900
14	7342	G-ウェルスナビ	2800
15	9158	G-シーユーシー	1500
16	9164	G-トライト	5000
17	9166	G-GENDA	3300
18	9204	G-スカイマーク	3600
19	9229	サンウェルズ	1700
20	9348	G-ospace	2700

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 ビジネスサポート本部 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6年8月6日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

37,520,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

13,555,415,830 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

361.29 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. 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 24年09月限	1,140 単位
-----------------------------------	----------

開示基準日における追加申込	3,120,000 口
開示基準日における換金(解約)請求	2,700,000 口

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:1569)
問合せ先 ビジネスサポート本部 山口 節一
(TEL:03-6843-1413)

『T O P I X ベア上場投信』に関する日々の開示事項

開示基準日:令和6年8月6日

1. 上場E T Fの上場受益権口数
(開示基準日現在)

4,886,000 口

2. 上場E T Fの純資産総額
(開示基準日現在)

7,039,151,375 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)

1,440.68 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)

-0.19 %

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

5. 連動対象指標の特徴と留意点

T O P I X インバース (ー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 T O P I X (配当なし) の前日比変動率 (%) * に対してー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 × T O P I X (配当なし) の前日比変動率)

※ T O P I X インバース (ー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

・ T O P I X インバース (ー1倍) 指数は、変動率が T O P I X (配当なし) (以下、「T O P I X」といいます。) の日々の変動率のー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 T O P I X のー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、T O P I X の変動率のー1倍以上又は未満となる場合があります。

・ T O P I X インバース (ー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、T O P I X の動きと逆に下落していく傾向があります。また、T O P I X 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 T O P I X インバース (ー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ペア上場投信

開示基準日におけるTOPIX先物取引の売建玉
24年09月限

356 単位

開示基準日における追加申込
開示基準日における換金(解約)請求

1,090,000 口
0 口

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:1572)
 問合せ先 ビジネスサポート本部 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6年8月6日

1. 上場ETFの上場受益権口数
 (開示基準日現在)

710,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
 (開示基準日現在)

2,550,612,465 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
 (開示基準日現在)

3,592.41 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)

0.66 %

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

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倍以上又は未滿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。)

24年08月限

921 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 ビジネスサポート本部 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6年8月6日

1. 上場E T Fの上場受益権口数
(開示基準日現在)

92,000 口

2. 上場E T Fの純資産総額
(開示基準日現在)

1,114,376,577 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)

12,112.79 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)

-0.04 %

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

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効です。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逓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。

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。)

24年08月限

206 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 ビジネスサポート本部 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6年8月6日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

168,100,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

37,912,047,322 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

225.53 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)

-2.19 %

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

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。

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 24年09月限	2,217 単位
-----------------------------------	----------

開示基準日における追加申込	14,040,000 口
開示基準日における換金(解約)請求	13,300,000 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 ビジネスサポート本部 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6年8月6日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

7,222,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

13,069,597,108 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

1,809.69 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)

1.09 %

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

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

日経平均ペア上場投信

開示基準日における日経225先物取引の売建玉 24年09月限	399 単位
-----------------------------------	--------

開示基準日における追加申込	270,000 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:1356)
問合せ先 ビジネスサポート本部 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6年8月6日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

9,030,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

3,972,502,868 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

439.92 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)

-0.63 %

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

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倍以上又は未満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。

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
24年09月限

329 単位

開示基準日における追加申込
開示基準日における換金(解約)請求

0 □

0 □

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 ビジネスサポート本部 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6年8月6日

1. 上場ETFの上場受益権口数
(開示基準日現在)

93,720,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
(開示基準日現在)

38,720,739,572 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
(開示基準日現在)

413.15 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)

2.18 %

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

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・インデックスは減価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 24年09月限	2,213 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	3,240,000 口

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:1469)
 問合せ先 ビジネスサポート本部 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6年8月6日

1. 上場ETFの上場受益権口数
 (開示基準日現在)

418,000 口

2. 上場ETFの純資産総額
 (開示基準日現在)

335,871,871 円

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額
 (開示基準日現在)

803.52 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)

3.65 %

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

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。

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 24年09月限	298 単位
--------------------------------------	--------

開示基準日における追加申込	0 □
開示基準日における換金(解約)請求	0 □

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：2516)
問合せ先 ビジネスサポート本部 山口 節一
(TEL：03-6843-1413)

『東証グロース250ETF』に関する日々の開示事項

開示基準日：令和6年8月6日

1. 上場E T F の上場受益権口数
(開示基準日現在)

40,880,000 口

2. 上場E T F の純資産総額
(開示基準日現在)

17,084,429,113 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)

417.92 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

東証グロース250ETF

開示基準日における東証グロース250指数先物取引の買建玉	
24年09月限	10,442 単位

開示基準日における追加申込	40,000 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:2555)
問合せ先 ビジネスサポート本部 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6年8月6日

1. 上場E T Fの上場受益権口数
(開示基準日現在)

33,702,041 口

2. 上場E T Fの純資産総額
(開示基準日現在)

58,098,942,289 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)

1,723.90 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)

0.00 %

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

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06年8月8日)、交換受付日(令和06年8月8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06年8月8日)、設定受付日(令和06年8月8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ーエスコンジヤパン	6
2	29720	RーサンケイRE	8
3	29790	RーSOSiLA物流	13
4	29890	Rー東海道リート	4
5	32260	RーアコモF	9
6	32340	Rー森ヒルズ	31
7	32490	Rー産業ファ	48
8	32690	RーADR	26
9	32790	RーAPI	13
10	32810	RーGLP	89
11	32820	Rーコンフォリア	13
12	32830	Rープロロジ	46
13	32870	Rー星野	5
14	32900	RーOneリート	4
15	32920	Rーイオンリート	32
16	32950	RーヒューリックRE	23
17	32960	Rー日本リート	8
18	33090	Rー積水ハウスリート	79
19	34510	Rートーセイ・リート	6
20	34550	RーHCM	6
21	34590	Rーサムティレジ	7
22	34620	RーNMF	85
23	34630	Rーいちごホテル	4
24	34660	Rーラサールロジ	34
25	34680	Rースターアジア	43
26	34700	Rーマリモリート	4
27	34710	Rー三井不ロジパーク	11
28	34720	Rー日本ホテル&レジ	4
29	34760	Rー投資法人みらい	36
30	34810	Rー三菱地所物流	9
31	34870	RーCREロジ	11
32	34880	Rーザイマックス	4
33	34920	Rータカラリート	15
34	34930	RーADL	11
35	89510	RービルF	31
36	89520	Rージャパン	27
37	89530	Rー都市ファンド	133
38	89540	RーオリックスF	52
39	89550	RーJプライム	18
40	89560	RーNTT都市開発R	27
41	89570	Rー東急RE	18
42	89580	Rーグローバル	19
43	89600	Rーユナイテッド	59
44	89610	Rー森トラスト	51
45	89630	RーINV	145
46	89640	Rーフロンティア	10

No.	銘柄コード	銘柄名	株式数
47	89660	R－平和RE	19
48	89670	R－ニホンロジ	18
49	89680	R－福岡	14
50	89720	R－KDX不動産	74
51	89750	R－いちごオフィス	19
52	89760	R－大和OF	11
53	89770	R－阪急阪神	12
54	89790	R－スターツPR	4
55	89840	R－ハウスリート	40
56	89850	R－JHR	97
57	89860	R－大和証券リビング	39
58	89870	R－エクセレント	23

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：2080)
問合せ先 ビジネスサポート本部 山口 節一
(TEL：03-6843-1413)

『 PBR1倍割れ解消推進ETF 』に関する日々の開示事項

開示基準日：令和6年8月6日

1. 上場E T Fの上場受益権口数
(開示基準日現在)

10,400,000 口

2. 上場E T Fの純資産総額
(開示基準日現在)

10,937,049,207 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)

1,051.64 円

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：2081)
問合せ先 ビジネスサポート本部 山口 節一
(TEL：03-6843-1413)

『 政策保有解消推進ETF 』に関する日々の開示事項

開示基準日：令和6年8月6日

1. 上場E T Fの上場受益権口数
(開示基準日現在)

1, 120, 000 口

2. 上場E T Fの純資産総額
(開示基準日現在)

1, 181, 723, 981 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)

1, 055. 11 円

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：2082)
問合せ先 ビジネスサポート本部 山口 節一
(TEL：03-6843-1413)

『 投資家経営者一心同体ETF 』に関する日々の開示事項

開示基準日:令和6年8月6日

1. 上場E T Fの上場受益権口数
(開示基準日現在)

450,000 口

2. 上場E T Fの純資産総額
(開示基準日現在)

419,390,647 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)

931.98 円

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:2094)
問合せ先 ビジネスサポート本部 山口 節一
(TEL:03-6843-1413)

『東証REITインバースETF』に関する日々の開示事項

開示基準日:令和6年8月6日

1. 上場E T Fの上場受益権口数
(開示基準日現在)

390,000 口

2. 上場E T Fの純資産総額
(開示基準日現在)

391,376,314 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)

1,003.53 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)

-0.06 %

5. 連動対象指標の特徴と留意点

東証REITインバース(-1倍)指数は、原指標である東証REIT 指数(配当なし)(以下、「東証REIT指数」といいます。)の前日比変動率に対して一定の負の倍数、すなわち-1倍、を乗じた変動率となるように計算された指数です。

東証REIT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性及び留意点

- ・東証REITインバース(-1倍)指数は、変動率が東証REIT指数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東証REIT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、東証REIT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。
- ・特に、東証REIT指数が上昇・下落を相互に繰り返す場合、上記の複利効果により東証REITインバース(-1倍)指数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。

以 上

東証REITインバースETF

開示基準日における東証REIT指数先物取引の売建玉 24年09月限	328 単位
--------------------------------------	--------

開示基準日における追加申込	160,000 口
開示基準日における換金（解約）請求	0 口