平成24年11月20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）

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、以下のとおり平成２４年１１月１９日の状況をご報告します。

上場ETF銘柄(7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	大証
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	JASDAQ−TOP20上場投信	1551	大証
4	マザーズ･コア上場投信	1563	東証
5	日経カバードコール指数上場投信	1565	東証
6	TOPIXブル2倍上場投信	1568	東証
7	TOPIXベア上場投信	1569	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

[掲載番号:1]
各　位

平成24年11月20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：1671）
問合せ先　業務本部　　山口　節一
（TEL：03－5208-5211）

『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:平成24年11月19日

１．上場ＥＴＦの上場受益権口数
（開示基準日現在）

834,000 口

２．上場ＥＴＦの純資産総額
（開示基準日現在）

3,766,958,099 円

３．上場ＥＴＦの一口あたりの純資産額
（開示基準日現在）

4,517 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）

-0.21 %

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

*対象指標は当該開示基準日のドル円顧客相場の仲値により、円換算しております。

５．上場ＥＴＦの終値と一口あたりの純資産額の乖離率
（開示基準日現在）

0.84 %

$$\text{乖離率} = \left(\frac{\text{上場ETFの終値}}{\text{上場ETFの一口あたりの純資産額}} - 1 \right) \times 100(\%)$$

以　上

[掲載番号:2]
各　位

平成24年11月20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：1679）
問合せ先　業務本部　　山口　節一
（TEL：03－5208-5211）

『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:平成24年11月19日

１．上場ＥＴＦの上場受益権口数
（開示基準日現在）

109,000 口

２．上場ＥＴＦの純資産総額
（開示基準日現在）

1,082,049,153 円

３．上場ＥＴＦの一口あたりの純資産額
（開示基準日現在）

9,927 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 %

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

*対象指標は当該開示基準日のドル円顧客相場の仲値により、円換算しております。

以　上

[掲載番号:3]
各　位

平成24年11月20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：1551）
問合せ先　業務本部　　山口　節一
（TEL：03－5208-5211）

『ＪＡＳＤＡＱ－ＴＯＰ２０上場投信』に関する日々の開示事項

開示基準日:平成24年11月19日

１．上場ＥＴＦの上場受益権口数
（開示基準日現在）

700,000 口

２．上場ＥＴＦの純資産総額
（開示基準日現在）

886,864,015 円

３．上場ＥＴＦの一口あたりの純資産額
（開示基準日現在）

1,267 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 %

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

５．上場ＥＴＦの終値と一口あたりの純資産額の乖離率
（開示基準日現在）

2.37 %

$$乖離率 = \left(\frac{上場ETFの終値}{上場ETFの一口あたりの純資産額} - 1 \right) \times 100(\%)$$

６．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

JASDAQ-TOP20上場投信

	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
2012/09/19	1,144.31	-0.04%	1,146	-0.09%	-0.05%	700,000	802,466,218
2012/09/20	1,128.13	-1.41%	1,130	-1.40%	0.02%	700,000	791,184,429
2012/09/21	1,135.97	0.69%	1,138	0.71%	0.01%	700,000	796,632,805
2012/09/24	1,147.98	1.06%	1,150	1.05%	0.00%	700,000	804,962,636
2012/09/25	1,151.95	0.35%	1,154	0.35%	0.00%	700,000	807,715,811
2012/09/26	1,162.05	0.88%	1,167	1.13%	0.25%	700,000	817,223,947
2012/09/27	1,163.81	0.15%	1,169	0.17%	0.02%	700,000	818,436,731
2012/09/28	1,180.79	1.46%	1,186	1.45%	0.00%	700,000	830,254,492
2012/10/01	1,181.70	0.08%	1,187	0.08%	0.01%	700,000	830,847,336
2012/10/02	1,185.37	0.31%	1,191	0.34%	0.03%	700,000	833,390,142
2012/10/03	1,181.70	-0.31%	1,187	-0.34%	-0.03%	700,000	830,822,889
2012/10/04	1,203.11	1.81%	1,208	1.77%	-0.04%	700,000	845,720,674
2012/10/05	1,215.27	1.01%	1,220	0.99%	-0.02%	700,000	854,178,241
2012/10/09	1,204.66	-0.87%	1,210	-0.82%	0.05%	700,000	846,742,881
2012/10/10	1,188.58	-1.33%	1,194	-1.32%	0.01%	700,000	835,530,435
2012/10/11	1,169.79	-1.58%	1,175	-1.59%	-0.01%	700,000	822,428,154
2012/10/12	1,157.98	-1.01%	1,163	-1.02%	-0.01%	700,000	814,191,065
2012/10/15	1,155.22	-0.24%	1,160	-0.26%	-0.02%	700,000	812,230,246
2012/10/16	1,162.30	0.61%	1,167	0.60%	-0.01%	700,000	817,153,306
2012/10/17	1,179.19	1.45%	1,184	1.46%	0.00%	700,000	828,901,294
2012/10/18	1,192.80	1.15%	1,198	1.18%	0.03%	700,000	838,374,112
2012/10/19	1,198.23	0.46%	1,203	0.42%	-0.04%	700,000	842,141,791
2012/10/22	1,223.66	2.12%	1,228	2.08%	-0.04%	700,000	859,814,620
2012/10/23	1,224.86	0.10%	1,229	0.08%	-0.02%	700,000	860,641,983
2012/10/24	1,211.95	-1.05%	1,217	-0.98%	0.08%	700,000	851,634,337
2012/10/25	1,213.36	0.12%	1,218	0.08%	-0.03%	700,000	852,601,823
2012/10/26	1,205.01	-0.69%	1,210	-0.66%	0.03%	700,000	846,779,294
2012/10/29	1,218.23	1.10%	1,223	1.07%	-0.02%	700,000	855,947,024
2012/10/30	1,205.01	-1.09%	1,210	-1.06%	0.02%	700,000	846,729,446
2012/10/31	1,213.05	0.67%	1,218	0.66%	-0.01%	700,000	852,317,006
2012/11/01	1,201.40	-0.96%	1,206	-0.99%	-0.02%	700,000	844,184,483
2012/11/02	1,205.22	0.32%	1,210	0.33%	0.01%	700,000	846,832,084
2012/11/05	1,226.17	1.74%	1,231	1.74%	0.00%	700,000	861,389,733
2012/11/06	1,214.56	-0.95%	1,219	-0.97%	-0.03%	700,000	853,292,077
2012/11/07	1,212.00	-0.21%	1,216	-0.25%	-0.04%	700,000	851,284,541
2012/11/08	1,200.44	-0.95%	1,205	-0.90%	0.05%	700,000	843,222,035
2012/11/09	1,233.61	2.76%	1,238	2.74%	-0.02%	700,000	866,309,647
2012/11/12	1,261.39	2.25%	1,265	2.18%	-0.07%	700,000	885,626,224
2012/11/13	1,242.22	-1.52%	1,246	-1.50%	0.02%	700,000	872,260,715
2012/11/14	1,281.37	3.15%	1,285	3.13%	-0.02%	700,000	899,512,899
2012/11/15	1,275.87	-0.43%	1,280	-0.39%	0.04%	700,000	895,667,184
2012/11/16	1,290.09	1.11%	1,294	1.09%	-0.02%	700,000	905,559,027
2012/11/19	1,263.30	-2.08%	1,267	-2.09%	-0.01%	700,000	886,864,015

JASDAQ-TOP20上場投信（交換に係わる交換口数）

※交換申込日（平成24年11月21日）、交換受付日（平成24年11月21日）分の交換口数は以下のとおりです。

交換口数 ： 1,985口

JASDAQ-TOP20上場投信（設定ポートフォリオ）

※設定申込日（平成24年11月21日）、設定受付日（平成24年11月21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	2138	クルーズ	1
2	2400	メッセージ	1
3	2656	ベクター	100
4	2702	日本マクドナルドホールディングス	100
5	3268	一建設	100
6	3765	ガンホー・オンライン・エンター	1
7	3811	ビットアイル	200
8	3858	ユビキタス	1
9	4080	田中化学研究所	100
10	4239	ポラテクノ	200
11	4348	インフォコム	1
12	4755	楽天	100
13	4817	ジュピターテレコム	1
14	4819	デジタルガレージ	1
15	6769	ザインエレクトロニクス	1
16	6787	メイコー	100
17	6871	日本マイクロニクス	100
18	6890	フェローテック	100
19	7458	第一興商	100
20	9438	エムティーアイ	1

[掲載番号:4]
各　位

平成24年11月20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　業務本部　　山口　節一
（TEL：03－5208-5211）

『マザーズ・コア上場投信』に関する日々の開示事項

開示基準日:平成24年11月19日

１．上場ＥＴＦの上場受益権口数
（開示基準日現在）

260,807 口

２．上場ＥＴＦの純資産総額
（開示基準日現在）

238,283,336 円

３．上場ＥＴＦの一口あたりの純資産額
（開示基準日現在）

914 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

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

マザーズ・コア上場投信

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
2012/09/14	822.62	0.31%	825	0.24%	-0.07%	908,500	749,613,588
2012/09/18	808.35	-1.73%	811	-1.70%	0.04%	908,500	736,586,947
2012/09/19	822.49	1.75%	825	1.73%	-0.02%	908,500	749,424,223
2012/09/20	832.44	1.21%	835	1.21%	0.00%	908,500	758,461,327
2012/09/21	829.64	-0.34%	832	-0.36%	-0.02%	908,500	755,898,309
2012/09/24	834.92	0.64%	837	0.60%	-0.04%	908,500	760,659,391
2012/09/25	829.33	-0.67%	832	-0.60%	0.07%	908,500	755,571,347
2012/09/26	836.35	0.85%	841	1.08%	0.24%	908,500	764,183,369
2012/09/27	825.18	-1.34%	830	-1.31%	0.03%	908,500	754,019,748
2012/09/28	825.43	0.03%	830	0.00%	-0.03%	908,500	754,231,271
2012/10/01	822.38	-0.37%	827	-0.36%	0.01%	908,500	751,416,334
2012/10/02	835.22	1.56%	840	1.57%	0.01%	908,500	763,078,409
2012/10/03	826.61	-1.03%	831	-1.07%	-0.04%	908,500	755,240,318
2012/10/04	849.28	2.74%	854	2.77%	0.03%	908,500	775,827,331
2012/10/05	864.87	1.84%	870	1.87%	0.04%	908,500	789,989,068
2012/10/09	862.81	-0.24%	867	-0.34%	-0.11%	908,500	788,059,986
2012/10/10	862.12	-0.08%	867	0.00%	0.08%	908,500	787,421,561
2012/10/11	861.68	-0.05%	866	-0.12%	-0.06%	848,846	735,115,294
2012/10/12	831.29	-3.53%	836	-3.46%	0.06%	848,846	709,300,828
2012/10/15	828.89	-0.29%	833	-0.36%	-0.07%	848,846	707,232,600
2012/10/16	839.15	1.24%	843	1.20%	-0.04%	752,971	635,078,307
2012/10/17	856.48	2.07%	861	2.14%	0.07%	752,971	648,107,929
2012/10/18	861.49	0.58%	866	0.58%	0.00%	657,127	568,860,476
2012/10/19	859.26	-0.26%	863	-0.35%	-0.09%	657,127	567,387,931
2012/10/22	871.75	1.45%	876	1.51%	0.05%	524,995	459,864,475
2012/10/23	883.22	1.32%	887	1.26%	-0.06%	524,995	465,860,238
2012/10/24	880.30	-0.33%	885	-0.23%	0.11%	392,854	347,502,820
2012/10/25	898.51	2.07%	903	2.03%	-0.03%	392,854	354,611,784
2012/10/26	899.47	0.11%	903	0.00%	-0.11%	260,807	235,614,451
2012/10/29	900.32	0.09%	905	0.22%	0.13%	260,807	236,030,970
2012/10/30	910.99	1.19%	915	1.10%	-0.08%	260,807	238,758,752
2012/10/31	913.30	0.25%	918	0.33%	0.07%	260,807	239,348,689
2012/11/01	928.54	1.67%	933	1.63%	-0.03%	260,807	243,277,614
2012/11/02	950.02	2.31%	954	2.25%	-0.06%	260,807	248,820,405
2012/11/05	949.53	-0.05%	953	-0.10%	-0.05%	260,807	248,673,974
2012/11/06	939.96	-1.01%	944	-0.94%	0.06%	260,807	246,195,136
2012/11/07	932.08	-0.84%	936	-0.85%	-0.01%	260,807	244,153,582
2012/11/08	925.95	-0.66%	930	-0.64%	0.02%	260,807	242,565,209
2012/11/09	913.33	-1.36%	918	-1.29%	0.07%	260,807	239,299,410
2012/11/12	895.61	-1.94%	900	-1.96%	-0.02%	260,807	234,701,484
2012/11/13	890.65	-0.55%	895	-0.56%	0.00%	260,807	233,415,344
2012/11/14	904.16	1.52%	908	1.45%	-0.06%	260,807	236,899,223
2012/11/15	897.39	-0.75%	902	-0.66%	0.09%	260,807	235,144,000
2012/11/16	895.82	-0.17%	900	-0.22%	-0.05%	260,807	234,732,354
2012/11/19	909.64	1.54%	914	1.56%	0.01%	260,807	238,283,336

マザーズ・コア上場投信（交換に係わる交換口数）

※交換申込日（平成24年11月21日）、交換受付日（平成24年11月21日）分の交換口数は以下のとおりです。

交換口数 ： 1,617口

マザーズ・コア上場投信（設定ポートフォリオ）

※設定申込日（平成24年11月21日）、設定受付日（平成24年11月21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	2121	ミクシィ	1
2	2174	GCAサヴィアングループ	1
3	2468	フュートレック	200
4	2492	インフォマート	1
5	3092	スタートトゥデイ	100
6	3627	ネオス	1
7	3778	さくらインターネット	100
8	3788	GMOクラウド	1
9	3843	フリービット	400
10	3853	インフォテリア	100
11	4751	サイバーエージェント	1
12	4813	ACCESS	1
13	4974	タカラバイオ	100
14	6255	エヌ・ピー・シー	100
15	7829	サマンサタバサジャパンリミテッド	1

[掲載番号:5]
各　位

平成24年11月20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：1565）
問合せ先　業務本部　　山口　節一
（TEL：03－5208-5211）

『日経カバードコール指数上場投信』に関する日々の開示事項

開示基準日:平成24年11月19日

１．上場ＥＴＦの上場受益権口数
（開示基準日現在）

100,000 口

２．上場ＥＴＦの純資産総額
（開示基準日現在）

1,028,976,910 円

３．上場ＥＴＦの一口あたりの純資産額
（開示基準日現在）

10,290 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

-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．交換にかかる有価証券のポートフォリオ　　（別紙参照）

６.連動対象指標の特徴と留意点

日経平均カバードコール・インデックス（対象指標）は、日経平均株価(日経平均)を原資産として、１ヵ月ごとに新しく期近のコール・オプション(大阪証券取引所オプション市場）を売り建てる「カバードコール戦略」を行った場合の収益を表すようにモデル化されています。具体的には、各限月の取引最終日翌日(ＳＱ日)にコール・オプションを清算するとともに、原資産である日経平均より5 %高いところの権利行使価格で、新たに直近限月となったコール・オプションを売り、そのプレミアムを理論上再投資した形となっています。
※日経平均カバードコール・インデックスについては、以下のＨＰをご覧ください。
https://www.simplexasset.com/jp/etf/top/unitport.html

対象指標の主な特徴および主な留意点
・対象指標は、日経平均がコール･オプションの行使価格を下回る水準で変動する場合には、対象指標も概ね日経平均と同じような変動となりますが、日経平均がコール･オプションの行使価格を上回る水準で変動する場合には、対象指標の変動は日経平均の変動と異なるものとなります。
・特に、日経平均がコール･オプションの行使価格を上回る水準にあって更に上昇するような局面においては、対象指標の変動は非常に限定的なものとなるため留意が必要となります。
・コール･オプションは、毎月のＳＱ日ごとに翌限月に変更となるため、その都度、日経平均の変動に対して対象指標の変動が限定的となる水準が変わります。また、ＳＱ日ごとのコール･オプションの売却プレミアムも変わります。
・日経平均の短期的な上昇に対して、日経平均がコール･オプションの行使価格を上回った場合、対象指標の上昇が限定的なものとなることがあります。

以　上

日経カバードコール指数上場投信

	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
2012/09/12	8,878.67	1.73%	10,070	1.71%	-0.03%	100,000	1,006,976,925
2012/09/13	8,913.54	0.39%	10,107	0.37%	-0.03%	100,000	1,010,702,510
2012/09/14	9,077.30	1.84%	10,285	1.76%	-0.08%	100,000	1,028,499,243
2012/09/18	9,046.83	-0.34%	10,257	-0.27%	0.06%	100,000	1,025,688,412
2012/09/19	9,141.79	1.05%	10,360	1.00%	-0.05%	100,000	1,036,006,541
2012/09/20	9,024.16	-1.29%	10,225	-1.30%	-0.02%	100,000	1,022,511,731
2012/09/21	9,045.07	0.23%	10,250	0.24%	0.01%	100,000	1,024,957,903
2012/09/24	9,012.53	-0.36%	10,213	-0.36%	0.00%	100,000	1,021,275,519
2012/09/25	9,035.66	0.26%	10,238	0.24%	-0.01%	100,000	1,023,820,107
2012/09/26	8,856.73	-1.98%	10,121	-1.14%	0.84%	100,000	1,012,096,662
2012/09/27	8,899.68	0.48%	10,165	0.43%	-0.05%	100,000	1,016,510,977
2012/09/28	8,823.36	-0.86%	10,079	-0.85%	0.01%	100,000	1,007,936,431
2012/10/01	8,751.08	-0.82%	9,999	-0.79%	0.03%	100,000	999,925,140
2012/10/02	8,740.67	-0.12%	9,985	-0.14%	-0.02%	100,000	998,534,030
2012/10/03	8,701.69	-0.45%	9,945	-0.40%	0.05%	100,000	994,486,129
2012/10/04	8,779.02	0.89%	10,030	0.85%	-0.03%	100,000	1,003,033,482
2012/10/05	8,817.53	0.44%	10,073	0.43%	-0.01%	100,000	1,007,349,518
2012/10/09	8,724.29	-1.06%	9,967	-1.05%	0.01%	100,000	996,663,059
2012/10/10	8,551.81	-1.98%	9,774	-1.94%	0.04%	100,000	977,363,181
2012/10/11	8,502.61	-0.58%	9,716	-0.59%	-0.02%	100,000	971,642,764
2012/10/12	8,491.01	-0.14%	9,704	-0.12%	0.01%	100,000	970,448,824
2012/10/15	8,537.73	0.55%	9,751	0.48%	-0.07%	100,000	975,132,653
2012/10/16	8,639.92	1.20%	9,868	1.20%	0.00%	100,000	986,829,066
2012/10/17	8,720.01	0.93%	9,954	0.87%	-0.06%	100,000	995,376,521
2012/10/18	8,826.12	1.22%	10,072	1.19%	-0.03%	100,000	1,007,171,060
2012/10/19	8,850.89	0.28%	10,091	0.19%	-0.09%	100,000	1,009,125,441
2012/10/22	8,843.93	-0.08%	10,093	0.02%	0.10%	100,000	1,009,281,303
2012/10/23	8,857.44	0.15%	10,099	0.06%	-0.09%	100,000	1,009,935,791
2012/10/24	8,817.57	-0.45%	10,065	-0.34%	0.11%	100,000	1,006,478,150
2012/10/25	8,873.36	0.63%	10,052	-0.13%	-0.76%	100,000	1,005,171,756
2012/10/26	8,816.33	-0.64%	9,987	-0.65%	0.00%	100,000	998,698,821
2012/10/29	8,832.58	0.18%	9,992	0.05%	-0.13%	100,000	999,150,343
2012/10/30	8,776.33	-0.64%	9,933	-0.59%	0.05%	100,000	993,331,244
2012/10/31	8,846.51	0.80%	10,017	0.85%	0.05%	100,000	1,001,681,827
2012/11/01	8,855.07	0.10%	10,033	0.16%	0.06%	100,000	1,003,341,094
2012/11/02	8,924.29	0.78%	10,100	0.67%	-0.11%	100,000	1,010,018,759
2012/11/05	8,910.54	-0.15%	10,089	-0.11%	0.05%	100,000	1,008,895,459
2012/11/06	8,903.26	-0.08%	10,080	-0.09%	-0.01%	100,000	1,007,996,227
2012/11/07	8,927.95	0.28%	10,097	0.17%	-0.11%	100,000	1,009,655,408
2012/11/08	8,819.42	-1.22%	9,982	-1.14%	0.08%	100,000	998,227,367
2012/11/09	8,741.02	-0.89%	9,898	-0.84%	0.05%	100,000	989,849,882
2012/11/12	8,663.91	-0.88%	9,812	-0.87%	0.01%	100,000	981,150,560
2012/11/13	8,649.53	-0.17%	9,799	-0.13%	0.03%	100,000	979,858,102
2012/11/14	8,654.21	0.05%	9,802	0.03%	-0.02%	100,000	980,238,461
2012/11/15	8,810.10	1.80%	9,972	1.73%	-0.07%	100,000	997,248,413
2012/11/16	8,983.43	1.97%	10,168	1.97%	0.00%	100,000	1,016,816,535
2012/11/19	9,097.40	1.27%	10,290	1.20%	-0.07%	100,000	1,028,976,910

日経カバードコール指数上場投信（交換に係わる交換口数）

※交換申込日（平成24年11月20日）、交換受付日（平成24年11月20日）分の交換口数は以下のとおりです。

交換口数 ： 10,000口

日経カバードコール指数上場投信（交換ポートフォリオ）

交換有価証券

	発行者	配分比率（%）（※注1）	配分額面（円）	（参考）総保有数量（円）	（参考）ISINコード
1	スウェーデン輸出信用銀行	100.00	98,000,000	984,000,000	XS0799545867

※注1 「配分比率」は、交換有価証券の時価合計を100%とした各有価証券の配分比率。

「ISINコード」とは、国際証券コード仕様ISO6166で定められている全世界共通の証券系コード。
各国一機関のみが自国のISINコードの付番権限を付与されています。

交換ポートフォリオの組入れ有価証券の参考情報（※） 1

※当該有価証券の主要な条件のみを要約して参考情報として記載するものであり、条件の全てを網羅しているものでないことをご留意下さい。

全ての組入れ有価証券の時価 ： 1,022,277,600 円
（開示基準日における組入れ有価証券の時価）

有価証券1

発行体名 スウェーデン輸出信用銀行
保有数量 984,000,000 円(額面)
発行日 2012年7月3日
満期日 2013年7月23日
額面金額 1,000,000 円
クーポン 第1回利金額（1額面金額当たり）= プレミアム2 + 配当1
第2回利金額（1額面金額当たり）= プレミアム3
第3回利金額（1額面金額当たり）= プレミアム4
第4回利金額（1額面金額当たり）= プレミアム5
第5回利金額（1額面金額当たり）= プレミアム6 + 配当2

プレミアム1 =
{ 投資単位 (0) × オプション (0) }
＋{ 投資単位 (1) × オプション (1) }
＋{ 投資単位 (2) × オプション (2) }
＋{ 投資単位 (3) × オプション (3) }

プレミアム2 =
{ 投資単位 (4) × オプション (4) }
＋{ 投資単位 (5) × オプション (5) }
＋{ 投資単位 (6) × オプション (6) }

プレミアム3 =
{ 投資単位 (7) × オプション (7) }
＋{ 投資単位 (8) × オプション (8) }
＋{ 投資単位 (9) × オプション (9) }

交換ポートフォリオの組入れ有価証券の参考情報(※)　2

プレミアム4 =
　{ 投資単位 (10) × オプション (10) }
＋{ 投資単位 (11) × オプション (11) }
＋{ 投資単位 (12) × オプション (12) }

プレミアム5 =
　{ 投資単位 (13) × オプション (13) }
＋{ 投資単位 (14) × オプション (14) }
＋{ 投資単位 (15) × オプション (15) }

プレミアム6 =
　{ 投資単位 (16) × オプション (16) }
＋{ 投資単位 (17) × オプション (17) }
＋{ 投資単位 (18) × オプション (18) }

投資単位 (i) = 投資金額 (i) / (日経平均 (i) ー オプション (i))

「日経平均 (i) 」は観測日iの日経平均終値、「オプション (i) 」は日経カバードコール指数算出に用いられている直近限月のコール・オプションの観測日 (i)における終値を意味しています。
観測日(i)の(i) について

i = 0	2011年12月9日
1	2012年1月13日
2	2012年2月10日
3	2012年3月9日
4	2012年4月13日
5	2012年5月11日
6	2012年6月8日
7	2012年7月13日
8	2012年8月10日
9	2012年9月14日
10	2012年10月12日
11	2012年11月9日
12	2012年12月14日
13	2013年1月11日
14	2013年2月8日
15	2013年3月8日
16	2013年4月12日
17	2013年5月10日
18	2013年6月14日
19	2013年7月12日

また、「投資金額 (i) 」は以下の算式によります。
投資金額 (0) = 1,000,000
投資金額 (1) = 投資金額 (0) x NKYCC (1) / NKYCC (0)
投資金額 (2) = 投資金額 (1) x NKYCC (2) / NKYCC (1)
投資金額 (3) = 投資金額 (2) x NKYCC (3) / NKYCC (2)
投資金額 (4) = 投資金額 (3) x NKYCC (4) / NKYCC (3) - プレミアム1
投資金額 (5) = 投資金額 (4) x NKYCC (5) / NKYCC (4)
投資金額 (6) = 投資金額 (5) x NKYCC (6) / NKYCC (5)
投資金額 (7) = 投資金額 (6) x NKYCC (7) / NKYCC (6) - プレミアム2
投資金額 (8) = 投資金額 (7) x NKYCC (8) / NKYCC (7)
投資金額 (9) = 投資金額 (8) x NKYCC (9) / NKYCC (8)
投資金額 (10) = 投資金額 (9) x NKYCC (10) / NKYCC (9) - プレミアム3

投資金額(11) = 投資金額(10) x NKYCC(11) / NKYCC(10)
投資金額(12) = 投資金額(11) x NKYCC(12) / NKYCC(11)
投資金額(13) = 投資金額(12) x NKYCC(13) / NKYCC(12) - プレミアム4
投資金額(14) = 投資金額(13) x NKYCC(14) / NKYCC(13)
投資金額(15) = 投資金額(14) x NKYCC(15) / NKYCC(14)
投資金額(16) = 投資金額(15) x NKYCC(16) / NKYCC(15) - プレミアム5
投資金額(17) = 投資金額(16) x NKYCC(17) / NKYCC(16)
投資金額(18) = 投資金額(17) x NKYCC(18) / NKYCC(17)
投資金額(19) = 投資金額(18) x NKYCC(19) / NKYCC(18) - プレミアム6

ここで、「NKYCC(i)」は、観測日iの日経カバードコール指数終値を意味しています。

配当1 =
　{投資単位(0) × 配当金額(1)}
＋{投資単位(1) × 配当金額(2)}
＋{投資単位(2) × 配当金額(3)}
＋{投資単位(3) × 配当金額(4)}
＋{投資単位(4) × 配当金額(5)}
＋{投資単位(5) × 配当金額(6)}
＋{投資単位(6) × 配当金額(7)}

配当2 =
　{投資単位(7) × 配当金額(8)}
＋{投資単位(8) × 配当金額(9)}
＋{投資単位(9) × 配当金額(10)}
＋{投資単位(10) × 配当金額(11)}
＋{投資単位(11) × 配当金額(12)}
＋{投資単位(12) × 配当金額(13)}
＋{投資単位(13) × 配当金額(14)}
＋{投資単位(14) × 配当金額(15)}
＋{投資単位(15) × 配当金額(16)}
＋{投資単位(16) × 配当金額(17)}
＋{投資単位(17) × 配当金額(18)}
＋{投資単位(18) × 配当金額(19)}

ここで、「配当金額(i)」は、概念的には、日経平均採用銘柄の各々について、観測日i-1　から観測日i　の間に、日経カバードコール指数の想定するカバードコール戦略のもとで投資金額(i)当たり保有すべき株数を保有していれば受け取ったであろう配当金の合計金額であって、実際には、このような概念に基づいて予め規定されたルールに則って算定された金額です。

利金支払日	第1回利払日	2012年7月23日
	第2回利払日	2012年10月23日
	第3回利払日	2013年1月23日
	第4回利払日	2013年4月23日
	第5回利払日	2013年7月23日
償還金額	投資金額(19)（1額面金額当たり）	

以　上

[掲載番号:6]
各　位

平成24年11月20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：1568）
問合せ先　業務本部　　山口　節一
（TEL：03－5208-5211）

『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:平成24年11月19日

１．上場ＥＴＦの上場受益権口数
（開示基準日現在）

770,000 口

２．上場ＥＴＦの純資産総額
（開示基準日現在）

6,394,767,293 円

３．上場ＥＴＦの一口あたりの純資産額
（開示基準日現在）

8,305 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

-0.10 %

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

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。
https://www.simplexasset.com/jp/etf/top/unitport.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倍以上又は未満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。

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	
12年12月限	1,679 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

[掲載番号:7]
各　位

平成24年11月20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：1569）
問合せ先　業務本部　　山口　節一
（TEL：03－5208-5211）

『ＴＯＰＩＸベア上場投信』に関する日々の開示事項

開示基準日:平成24年11月19日

１．上場ＥＴＦの上場受益権口数
（開示基準日現在）

270,000 口

２．上場ＥＴＦの純資産総額
（開示基準日現在）

2,853,184,474 円

３．上場ＥＴＦの一口あたりの純資産額
（開示基準日現在）

10,567 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

0.03 %

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

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。
https://www.simplexasset.com/jp/etf/top/unitport.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ベア上場投信

開示基準日におけるTOPIX先物取引の売建玉	
12年12月限	374 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