

平成 30 年 1 月 15 日

ニュースリリース

シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目 5 番 1 号  
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第 341 号  
加入協会 一般社団法人投資信託協会、一般社団法人日本投資顧問業協会

日本初の東証マザーズ指数 ETF、  
東証マザーズ ETF の新規設定について

シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社（代表取締役社長：水嶋浩雅、以下「シンプレクス AM」）は、日本初の東証マザーズ指数に連動する「東証マザーズ ETF」を新規設定することといたしました。1 月 31 日に設定を行い、2 月 1 日に東京証券取引所への上場を予定しております。

シンプレクスAMは今後も投資家の皆様の利便に資することを旨として、ETFの開発・運用に努めてまいります。

「東証マザーズ ETF」の概要は以下の通りです。

「東証マザーズ ETF」の概要

ファンド名	東証マザーズETF
上場市場	東京証券取引所
上場日	平成 30 年 2 月 1 日（予定）
銘柄コード	2516
信託期間	無期限（平成 30 年 1 月 31 日設定予定）
取引単位	10 口

東証マザーズ ETF（以下「ファンド」又は「当ファンド」といいます。）は、東証マザーズ指数を対象指標とし、株価指数先物取引の買い建て、または対象指標に採用されている株式への投資、あるいは株価指数先物取引の買い建てと対象指標に採用される株式への投資のいずれも行うことにより、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す追加型株式投資信託です。

※ 東証マザーズ指数について

東証マザーズ指数は、東京証券取引所マザーズに上場する内国株全銘柄を対象とした、浮動株ベースの時価総額加重型で算出される株価指数です。東京証券取引所が算出・公表しています。算出方法は 2003 年 9 月 12 日の時価総額を 1,000 ポイントとして、その後の時価総額を指数化したものです。

- ① 東証マザーズ指数の指数値並びに東証及びM o t h e r s \マザーズの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」という。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用など東証マザー

- ズ指数に関するすべての権利・ノウハウ並びに東証及びM o t h e r s \マザーズの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有します。
- ② (株)東京証券取引所は、東証マザーズ指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証マザーズ指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証及びM o t h e r s \マザーズの指数の商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。
  - ③ (株)東京証券取引所は、東証マザーズ指数の指数値及び東証及びM o t h e r s \マザーズの商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の東証マザーズ指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
  - ④ (株)東京証券取引所は、東証マザーズ指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、(株)東京証券取引所は、東証マザーズ指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
  - ⑤ 本件商品は、(株)東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。
  - ⑥ (株)東京証券取引所は、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
  - ⑦ (株)東京証券取引所は、当社又は本件商品の購入者のニーズを、東証マザーズ指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
  - ⑧ 以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

◆ 手数料等の概要

<取得・換金時にご負担いただく費用>

申 込 手 数 料	<p>取得申込受付日の翌営業日の基準価額に販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。当該手数料にかかる消費税等相当額を含みます。</p> <p>※詳しくは、販売会社にお問い合わせください。</p> <p>※申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。</p>
換 金 ( 解 約 ) 手 数 料	<p>① 換金手数料</p> <p>販売会社は、受益者が解約請求を行なうときおよび受益権の買取りを行なうときは、当該受益者から、販売会社が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を徴収することができるものとします。</p> <p>※詳しくは、販売会社にお問い合わせください。</p> <p>※換金手数料は、換金時の事務手続きなどに係る対価です。</p> <p>② 信託財産留保額</p> <p>解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.5%の率を乗じて得た額（1口当たり）を上限とし、ご換金時にご負担いただきます。（有価証券届出書提出日現在）</p> <p>※「信託財産留保額」とは、投資信託を解約される受益者の解約代金から差し引いて、信託財産に繰り入れる金額のことです。</p>

◆ 信託財産で間接的にご負担いただく費用

信 託 報 酬	<p>① 信託報酬</p> <p>委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、下記1)により計算した額に、下記2)により計算した額を加算して得た額とします。</p> <p>1) 信託財産の純資産総額に年 10,000 分の 54.0(消費税込)以内の率を乗じて得た額</p>								
$\text{信託報酬} = \text{運用期間中の基準価額} \times \text{信託報酬率}$									
<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 30%;">総額</td> <td colspan="2" style="text-align: center;">0.54%(税抜 0.5%)(有価証券届出書提出日現在)</td> </tr> <tr> <td rowspan="2" style="text-align: center;">配分</td> <td style="text-align: center;">委託会社</td> <td style="text-align: center;">受託会社</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">0.45%(税抜)</td> <td style="text-align: center;">0.05%(税抜)</td> </tr> </table>		総額	0.54%(税抜 0.5%)(有価証券届出書提出日現在)		配分	委託会社	受託会社	0.45%(税抜)	0.05%(税抜)
総額	0.54%(税抜 0.5%)(有価証券届出書提出日現在)								
配分	委託会社	受託会社							
	0.45%(税抜)	0.05%(税抜)							
<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td colspan="2" style="text-align: center;">役務の内容</td> </tr> <tr> <td style="width: 50%; text-align: center;">委託会社</td> <td style="text-align: center;">委託した資金の運用の対価</td> </tr> </table>		役務の内容		委託会社	委託した資金の運用の対価				
役務の内容									
委託会社	委託した資金の運用の対価								

	受託会社	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価
	2) 株式の貸付を行った場合は、その品貸料の 54.0% (消費税込) 以内の額	
	総額	54.0% (税抜 50.0%) (有価証券届出書提出日現在)
	配分	委託会社 40.0% (税抜)
		受託会社 10% (税抜)
	<p>※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。</p> <p>② 支払時期</p> <p>信託報酬(信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。)は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。</p>	
その他の費用	<p>① 当ファンドに関する組入有価証券および先物取引の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税等に相当する金額、先物取引等に要する費用は信託財産から支払われます。</p> <p>② 信託財産において一部解約代金の支払資金等に不足額が生じるときに資金の借入を行った場合、その借入金の利息は、受益者の負担とし信託財産から支払われます。</p> <p>③ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、随時、信託財産中から支弁します。</p> <p>④ 上記③に定める諸費用にかかわらず、以下の諸費用(消費税等相当額を含みます。)は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁することができます。なお、下記 a. から g. までに該当する業務を委託する場合は、その委託費用を含みます。</p> <p>a. この信託の計理業務(設定解約処理、約定処理、基準価額算出、決算処理等)およびこれに付随する業務(法定帳簿管理、法定報告等)に係る費用</p> <p>b. 振替受益権に係る費用ならびにやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合における発行および管理事務に係る費用</p> <p>c. 有価証券届出書、有価証券報告書および臨時報告書(これらの訂正に係る書類を含みます。)の作成、印刷および提出に係る費用</p> <p>d. 目論見書(交付目論見書、請求目論見書および訂正事項分を含みます。)の作成、印刷および交付に係る費用(これらを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。)</p> <p>e. 信託約款の作成、印刷および交付に係る費用(これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。)</p> <p>f. 運用報告書および決算短信等開示資料の作成、印刷および交付に係る費用(これらを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。)</p> <p>g. この信託の受益者に対して行う公告に係る費用ならびに信託約款の変更または信託契約の解約に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用</p> <p>h. 格付の取得に要する費用</p> <p>i. この信託の監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用(信託財産に係る特定資産の価格調査に係る費用を含みます。)</p> <p>j. 受益権の上場に係る費用※</p> <p>k. ファンドにおいて、約款に定める基本方針に沿う運用を行うために必要な東証マザーズ指数の指数値、構成銘柄、構成比率などの情報の入手に要する費用</p> <p>※ファンドの上場に係る費用</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・新規上場および追加上場料: 新規上場時の純資産総額に対して、及び追加上場時の増加額(毎年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額)に対して、0.0081% (税抜 0.0075%)。</li> <li>・毎年末の純資産総額に対して、0.0081% (税抜 0.0075%) 及び TDnet 利用料。</li> </ul> <p>⑤ 委託会社は、上記③および④に定める諸費用の支払いを信託財産のために行い、支払金額の支弁を信託財産から受けることができ、また、現に信託財産のために支払った金額の支弁を受けることについて、あらかじめ受領する金額に上限を付することができます。この場合、委託会社は、信託財産の規模等を考慮して、係る上限額を何時にても見直すことができます。</p> <p>⑥ 上記⑤に基づいて実際に支払った金額の支弁を受ける代わりに、委託会社は、係る諸費用の金額をあらかじめ合理的に見積もった上で、実際の費用額にかかわらず、合理的な</p>	

	<p>見積率により計算した金額を諸費用とみなして、その支弁を信託財産から受けることもできます。この場合、委託会社は、係る見積率に上限を付することとし、また信託財産の規模等を考慮して、係る見積率の上限を何時にても見直すことができるものとします。</p> <p>⑦ 上記⑥の場合において、上記③および④に定める諸費用としてみなす額は、信託財産の純資産総額に見積率(前項に規定する見積率の上限は、年 10,000 分の 20 とします。)を乗じて得た額とし、約款に規定する計算期間を通じて毎日計上され、委託会社が定めた時期に信託財産中から支弁するものとします。</p>
--	---

◆ 投資リスク

(1) ファンドのリスク

当ファンドは、株式や公社債等、短期金融資産（以下「有価証券等」）を投資対象とし、株価指数先物取引などのデリバティブ取引を利用するため、これらの価格変動の影響により基準価額は変動します。従いまして、投資元金を割り込むことがあり、元本が保証されているものではありません。投資信託は預貯金と異なります。また、金融機関の預金あるいは保険契約ではないため、預金保険機構、保険契約者保護機構の保護の対象とはなりません。

信託財産に生じた利益および損失はすべて受益者に帰属します。

当ファンドに投資される前に当ファンドの性質、複雑性および内在するリスクがご自身の投資経験や財務状況に照らして投資目的に合致しているかどうかご確認ください。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

① 価格変動リスク

株式の価格は国内および国際的な政治・経済情勢の影響を受けて変動します。株式の価格が大幅に下落した場合、ファンドの投資成果に重大な損失が生じることとなります。

当ファンドにおいては、国内株式市場のなかで比較的時価総額の小さな銘柄の株式に投資します。これらの銘柄は、国内株式市場全体の平均に比べて結果としてより大きな変動となる可能性があります。国内株式市場全体の平均よりも大幅に下落し、ファンドの投資成果に重大な損失が生じることとなる場合があります。

株価指数先物取引の価格は、株価指数の計算根拠となる対象企業の株価や、株式市場全般の値動きに影響を受けて変動します。国内外の株価指数の値動きや株式市場全般の値動きに影響を受けて変動することもあります。当ファンドにおいて買い建てた株価指数先物取引の価格が予想外に下落し、ファンドの投資成果に重大な損失が生じることとなる場合があります。株価指数先物取引の原資産である株価指数の構成銘柄が国内株式市場のなかで比較的時価総額の小さな銘柄である場合や、いわゆる新興企業である場合は、株式市場全体の動きと比較して価格変動が大きな変動となる可能性があります。株価指数先物取引の原資産の株価指数が国内株式市場全体の平均よりも大幅に下落することで株価指数先物取引の価格も大幅に下落し、ファンドの投資成果に重大な損失が生じることとなる場合があります。

② 流動性リスク

有価証券等を売却もしくは購入、又は株価指数先物取引を買い建てるとしくは解消しようとする際に、買い需要がないことによる売却不可能、売り供給がないことにより購入不可能となる、又は流動性等がなく株価指数先物取引が行えない可能性があります。また、市場等の取引規制により、不利な価格で取引を行わざるをえない可能性があります。市場動向、市場や行政等による規制、有価証券等及びデリバティブ取引の流通量などの状況、又は当ファンドの解約金額の規模によっては、組入有価証券等を市場実勢より低い価格で売却しなければならない又は、高い価格で買付しなければならないケースが考えられ、この場合には基準価額の下落要因となります。

当ファンドにおいて投資する、国内株式市場のなかで比較的時価総額の小さな銘柄や新興企業の株式や、それらを構成銘柄とする株価指数を原資産とする株価指数先物取引は、国内株式市場全体のなかで取引量が小さく、流動性が低いいため、売買が不可能となったり、不利な価格で取引を行わざるをえない可能性が高くなります。この場合には基準価額がより大きく下落する要因となります。

### ③ 信用リスク

一般に、投資した企業の経営などに重大な危機が生じた場合、債務不履行が生じた場合またはそれが予想される場合には、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、基準価額が下落します。

また、当ファンドは、コール・ローンなどの短期金融資産で運用することがありますが、相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落します。

### ④ 為替変動リスク

外貨建資産については、一般に為替相場の影響により変動します。外貨建資産の通貨に対して円高になった場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となります。

### ⑤ 金利変動リスク

当ファンドでは、公社債やコール・ローン等を投資対象とします。一般に金利が上昇した場合には債券価格は下落し、損失が生じることがあります。

### ⑥ デリバティブ取引に関するリスク

当ファンドは、株価指数先物取引などのデリバティブ取引を利用します。株価指数先物取引などのデリバティブ取引の価値は基となる原資産価値等に依存し、またそれらによって変動します。デリバティブ取引の価値は、種類によっては、基となる原資産の価値以上に変動することや、原資産とデリバティブ取引との間の相関性を欠いてしまう可能性もあります。また、流動性を欠く可能性、市場混乱時や取引相手の倒産等により当初の契約通りの取引を実行できず損失を被るリスク、取引を決済する場合に反対売買ができなくなるリスク、理論価格よりも大幅に不利な条件でしか反対売買ができなくなるリスク等があります。これらデリバティブ取引に関するリスクによって、損失が生じることがあります。

### ⑦ レバレッジに関するリスク

当ファンドは、株価指数先物取引などのデリバティブ取引を利用します。株価指数先物取引の買い建て総額は、純資産総額に対してほぼ同額となる場合があります（レバレッジ比率）。

なお、株価指数先物取引の買い建て総額が純資産総額に対して上回る場合があります。ただし、その場合であっても、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により「リスク量」として算出した額は信託財産の純資産総額を超えないものとします。

### ⑧ 有価証券の貸付等におけるリスク

有価証券の貸付等において、取引先リスク(取引の相手方の倒産等により契約が不履行になる危険のこと)が生じる可能性があります。

※基準価額の変動要因（投資リスク）は上記に限定されるものではありません。

(2) その他の留意点

① 金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定にしたがい、委託会社の判断で受益権の設定及び一部解約の受付を中止することがあります。

② 対象指標と基準価額のかい離リスク

当ファンドは、東証マザーズ指数を対象指標とし、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ますが、以下のような要因により、対象指標の変動率と完全に一致した運用成果をお約束するものではありません。また、対象指標と基準価額が一致することを保証することはできません。

1. 東証マザーズ指数の採用銘柄の変更や資本異動などによってポートフォリオの調整が行われる場合、個別銘柄の流動性の低さなどから、対象指標と同じタイミングでポートフォリオの調整をすることができず、また調整に相当の期間を要してしまい、結果としてポートフォリオと対象指標の構成銘柄および構成比率が異なり、対象指標の変動率と一致しなくなる可能性があり、対象指標の変動率とファンドの基準価額の変動率にかい離が生じることがあります。
2. 東証マザーズ指数の採用銘柄の変更や資本異動などによってポートフォリオの調整が行われる場合、個別銘柄の売買などにあたりマーケット・インパクトを受ける可能性があり、対象指標の変動率とファンドの基準価額の変動率にかい離が生じることがあります。
3. 株価指数先物取引などのデリバティブ取引を利用しますが、当該取引の値動きと対象指標との値動きが一致しないことにより、対象指標の変動率とファンドの基準価額の変動率にかい離が生じることがあります。
4. 株価指数先物取引には先物満期日(以下「限月」)があるため、当該先物取引を異なる限月の取引に乗り換えていくこと(「ロールオーバー」といいます。)となります。このとき、買い建てている先物を売却し、乗り換え対象となる限月の先物を買って建てることとなりますが、限月が異なるため2つの先物取引には元来価格差があります。それにより、対象指標の変動率とファンドの基準価額の変動率にかい離が生じることがあります。
5. 信託報酬、売買委託手数料、その他の費用などをファンドが負担することにより、対象指標の変動率とファンドの基準価額の変動率にかい離が生じることがあります。
6. 組入銘柄の配当金や有価証券の貸付による品貸料が発生することにより、対象指標の変動率とファンドの基準価額の変動率にかい離が生じることがあります。
7. 資金の流出入により基準価額の変動率とかがい離が生ずる可能性があります。
8. 信託報酬、売買委託手数料、その他の費用等のコスト負担が、対象指標の変動率とファンドの基準価額の変動率とのかい離の要因になります。

③ 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、設定または解約に制限を設けることがあります。

当ファンドは、株価指数先物取引のうち主として取引を行うものについて、次の 1.または 2.に該当する場合には、販売会社は、前営業日の取得申込みの取消しを行うものとします。また、次の 1.または 2.に該当する場合には、委託会社は、前営業日の一部換金(解約)の実行の請求を取消することができます。

1. 株価指数先物取引にかかる金融商品取引所の取得申込日もしくは解約請求日の翌営業日の午後立会が行われないとき、もしくは停止されたとき。
2. 取得申込日もしくは解約請求日の翌営業日の株価指数先物取引にかかる金融商品取引所の午後立会終了時における株価指数先物取引の呼値が当該金融商品取引所が定める呼値の値幅の限度の値段とされるなどやむを得ない事情が発生したことから、当ファンドの株価指数先物取引にかかる呼値の取引数量の全部もしくは一部についてその取引が成立しないとき。

④ 金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定にしたがい、委託会社の判断で受益権の設定及び換金(解約)請求の受け付けを中止することがあります。

- ⑤ 分配金は、分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、分配を行わない場合があります。
- ⑥ 当ファンドの基準価額の計算は、法令および一般社団法人投資信託協会規則等に従って時価評価を行います。有価証券等及びデリバティブ取引の評価は、基準価額計算日に知りうる直近の日の価格です。
- ⑦ 当ファンドの受益権は、東京証券取引所に上場し、当該取引所で取引されますが、その取引価格は、当ファンドの運用に対する評価や当該取引所における需給関係によって形成されるため、対象指標や基準価額と一致した推移とならず、一般にかい離を生じます。また、当ファンドの受益権は当該取引所において活発な取引が行われるという保証はありません。したがって、当ファンド受益権の取引がまったく行われなかったり取引が行われたとしても制限的で当ファンドの受益権の当該取引所における取引価格に悪影響したり購入者が処分に窮する場合があります。また、同取引所においてどのような価格で取引がなされるのかを予想することはできません。さらに、指定参加者(当ファンドの募集の取り扱いを行う者で、当ファンドの販売会社。)は当ファンド受益権の当該取引所における円滑な流通の確保に努めることとなっておりますが、継続的に呼び値を提示する義務を負うものではありませんので、市場での需給の状況によっては、当ファンドを希望する時にまたは希望する価格で売買することが困難となる場合又は売買すること自体が不可能となる場合があります。
- ⑧ 受益権は、委託会社と受託会社との協議により、一定日現在の受益権を均等に再分割もしくは併合されることがあります。
- ⑨ 受益権の総口数が 30 万口を下回った場合、信託期間中であっても償還されることがあります。
- ⑩ 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場合は、繰り上げ償還されます。
- ⑪ 適用となる法令・税制・会計制度等は、今後、変更される可能性があります。
- ⑫ ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第 37 条の6の規定(いわゆるクーリングオフ)の適用はありません。

当資料は、ニュースリリースとしてシンプレクス・アセット・マネジメント株式会社が作成した資料であり、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。当資料は、信頼できると判断した情報に基づき作成されていますが、情報の正確性・完全性について弊社が保証するものではありません。当資料に掲載されている内容等は、当資料作成時点のものです。また、当資料に示された見解は、当資料作成時点における弊社の判断によるものです。当資料中のいかなる内容も、将来の市場環境等の変動を保証するものではありません。当資料中のいかなる内容も、将来の運用成果等を保証するものではありません。投資信託の受益権の基準価額は、投資信託に組入れられている有価証券等の特性による値動きにより影響を受け、投資元本を割り込むことがあります。これらの運用による損益はすべて投資家の皆様に帰属します。従いまして、投資信託は元本が保証されるものではありません。投資信託は預貯金と異なります。投資信託をお申込みの際は、最新の投資信託説明書(交付目論見書)をあらかじめまたは同時にお渡しいたしますので、必ず、運用方針およびリスク要因等、手数料の合計、報酬等の内容をご確認のうえ、ご自身でご判断ください。投資信託説明書(交付目論見書)につきましては、販売会社にご請求下さい。投資信託は、預金保険機構及び保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、証券会社以外の登録金融機関で購入された投資信託は、投資者保護基金の支払対象にはなりません。委託会社は、金融商品取引法第 5 条の規定により有価証券届出書を平成 30 年 1 月 15 日に提出しておりますが、その効力は生じておりません。