マンスリーレポート

Simplex Asset Management

東証グロース・コアETF

2025年3月31日

追加型／国内／株式／ETF／インデックス型

ファンドの特色

東証グロース・コアETF（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）は、東証グロース市場 Core 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て、東証グロース市場 Core 指数に採用されている株式に投資を行ないます。

※ 東証グロース市場 Core 指数について
東証グロース市場Core指数は、東証グロース市場※指数の算出対象を母集団とし、上場時価総額、流動性を基準として、JPX総研が選定した銘柄を算出対象としています。
算出開始当初は、20銘柄で構成されます。算出対象の定期入替は毎年1回（10月最終営業日）行われます。定期入替に係る基準日（以下、「定期入替基準日」といいます。）は、毎年8月最終営業日、キャップ調整に係るウエイト計算における基準日（以下、「ウエイト基準日」といいます。）は毎年9月最終営業日とし、追加・除外リストは10月第5営業日に公表されます。
個別銘柄のウエイト上限は20%とされますが、ウエイトが上限を超える銘柄については、10月最終営業日に修正係数が設定されます。その後に株価の変動等により上限を超える場合も翌年の10月最終営業日まで修正係数は変更しないものとなっておりますので、ウエイトが20%を超える銘柄が東証グロース市場Core指数には含まれます。
算出開始日：2022年（令和4年）4月4日　基準日：2022年（令和4年）4月1日　基準値：1,000.00円
※ 2022年4月4日の新しい市場区分へと再編以降の東証グロース市場をいいます。
＊東証グロース・コアETFは2022年10月7日にマザーズ・コア上場投信から名称変更を行い、対象指標も東証マザーズCore指数から東証グロース市場 Core 指数に変更を行いました。

【設定日】	2011年11月28日	【上場取引所】	東京証券取引所	【基準価額】	2,202円
【決算日】	年1回　毎年7月8日	【証券コード】	1563	【純資産総額】	30.58億円
【信託期間】	無期限	【上場日】	2011年11月29日		
		【売買単位】	1口		

◆基準価額の騰落率

	1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年間	3年間	設定来
ファンドの騰落率	-8.06%	-10.60%	-1.78%	-14.88%	-12.48%	148.69%

※ 設定来騰落率は設定日2011年11月28日から直近までの騰落率です。

◆基準価額の推移

◆分配金実績（税引前、1口当たり）

決算日	分配金（円）
2020/7/8	31
2021/7/8	37
2022/7/8	0
2023/7/8	0
2024/7/8	0
設定来合計	298

※ 上記は過去のものであり、将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

◆資産内容

資産構成比	
国内株式	98.98%
コール・ローン等、その他	1.02%

※ 組入比率は、純資産総額に対するものです。

◆対象指標構成銘柄の組入比率（上位10銘柄）

	銘柄名	組入比率
1	GENDA	13.90%
2	ジーエヌアイグループ	12.66%
3	ライフネット生命保険	10.87%
4	タイミー	6.60%
5	カバー	5.88%
6	BuySell Technologies	5.45%
7	フリー	4.98%
8	インテグラル	4.18%
9	弁護士ドットコム	4.04%
10	アストロスケールホールディングス	3.82%

※ 期間別騰落率は、基準価額の騰落率です。投資家利回りとは異なります。
※ 基準価額の騰落率は、分配金（税引前）を再投資し計算しております。
※ 基準価額は、計算において信託報酬等は控除されています。
※ 運用状況は、過去の実績を示したものであり、将来の運用成果を保証するものではありません。

■当資料は、シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社（以下「弊社」といいます。）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していますが、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数値・図表等は、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。また、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や又、為替相場の変動等の影響を受けますが、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。また、投資成果を事前に保証するものではありません。投資信託は預貯金とは異なります。■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、運用方針及びリスク要因等、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。■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。■当資料の内容については、予告なく変更される場合があります。■当資料の無断転写、転載は出来ません。当資料の第三者への提供は固くお断りいたします。

【投資リスク】
(1) ファンドのリスク
当ファンドは、株式を投資対象としているため、これら投資対象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特約ではないため、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。銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払い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。

② 流動性リスク
有価証券等を売却あるいは購入しようとする際に、買い需要が無く売却不可能、あるいは売り供給が無く購入不可能等となるリスクのことをいいます。市場規模が小さい或いは取引量が少ない状況では、有価証券の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できない、評価価格どおりに売却できない、あるいは、価格の高低に関わらず取引量が限られてしまう可能性があり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。

③ 信用リスク
投資している有価証券等の発行会社の倒産、財務状況または信用状況の悪化等の影響により有価証券等の価格が下落すると、ファンドの基準価額の下落要因となります。

④ 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。

⑤ 対象指標と基準価額のかい離リスク
当ファンドは、東証グロース市場Core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。
- 東証グロース市場Core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なわれる場合、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ること。
- 東証グロース市場Core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なわれる場合、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ること。
- 信託報酬・売買委託手数料、監査費用などの費用をファンドが負担すること。
- 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。
- 先物取引等のデリバティブ取引を利用した場合、当該取引の値動きと東証グロース市場Core指数の採用銘柄の一部または全部の値動きが一致しないこと。

東証グロース市場Core指数の著作権等について
① 東証グロース市場Core指数の指数値及び東証グロース市場Core指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証グロース市場Core指数に関するすべての権利・ノウハウ及び東証グロース市場Core指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。
② JPXは、東証グロース市場Core指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証グロース市場Core指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証グロース市場Core指数に係る標章若しくは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 JPXは、東証グロース市場Core指数の指数値及び東証グロース市場Core指数に係る標章又は商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の東証グロース市場Core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 JPXは、東証グロース市場Core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、JPXは、東証グロース市場Core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 当ファンドは、JPXにより提供、保証又は販売されるものではありません。
⑥ JPXは、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明又は投資のアドバイスをする義務を負いません。
⑦ JPXは、当社又は当ファンドの購入者のニーズを東証グロース市場Core指数の指数値を算出する銘柄構成及び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、JPXは当ファンドの設定、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。

(2) その他の留意点
① 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。

② 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交換等の受付を中止することがあります。

③ 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。

④ 当ファンドの基準価額の計算は、法令および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。有価証券等及び先物取引の評価は、基準価額計算日に知りうる直近の日の価格です。

⑤ 当ファンドは、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、対象株価指数や基準価額と一致した推移とならず、一般に乖離を生じます。また、当ファンドの信託金限度額は、他の上場投資信託に比較して少額であるため、当ファンドの取引価格と対象株価指数や基準価額との乖離は、相対的に大きなものになる可能性があります。

■当資料は、シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社(以下「弊社」といいます。)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していますが、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数値・図表等は、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。また、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や又、為替相場の変動等の影響を受けますが、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。また、投資成果を事前に保証するものではありません。投資信託は預貯金とは異なります。■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、運用方針及びリスク要因等、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。■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。■当資料の内容については、予告なく変更される場合があります。■当資料の無断転写、転載は出来ません。当資料の第三者への提供は固くお断りいたします。

⑥ 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。

⑦ ETFを金融商品取引所で売買される場合には、委託会社作成の投資信託説明書（交付目論見書）は交付されません。売買をお申込みになる証券会社に、当該取引の内容についてご確認ください。

＜ファンドの費用＞

投資者が直接的に負担する費用	
取得時手数料	取得申込受付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。詳しくは、販売会社または委託会社の照会先にお問合せください。 ※取得時手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに取得に関する事務コストの対価です。
信託財産留保額	ありません。
交換時手数料	交換請求受付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。詳しくは、販売会社または委託会社の照会先にお問合せください。 ※交換時手数料は、交換時の事務手続きなどに係る対価です。
投資者が信託財産で間接的に負担する費用	
運用管理費用（信託報酬）	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。 ①信託財産の純資産総額に<u>年10,000分の55.0（消費税込）以内の率</u>を乗じて得た額 運用管理費用（信託報酬）＝運用期間中の基準価額×信託報酬率 総額：年率0.55%（税抜0.5%） 配分：委託会社 年率0.45%（税抜）／受託会社 年率0.05%（税抜） 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<u>55.0%（消費税込）以内の額</u> 総額：55.0%（税抜50.0%） 配分：委託会社 40.0%（税抜）／受託会社 10.0%（税抜） 上記の信託報酬は、日々計上され、毎計算期間末または信託終了日のとき信託財産中から支弁するものとします。
その他費用・手数料	■組入有価証券または先物取引等の売買の際に発生する売買委託手数料、組入有価証券の決済・保管費用、受益者原簿管理に係る費用、ファンド監査費用、有価証券届出書、有価証券報告書、交付目論見書、請求目論見書および訂正事項分の作成、印刷および提出または交付に係る費用、信託約款の作成、印刷および提出または交付に係る費用、運用報告書および決算短信など開示資料の作成、印刷および提出または交付に係る費用、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契約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、印刷および提出または交付に係る費用、「東証グロース市場Core指数」その他これに類する標章の使用料等。 ■ファンドの上場に係る費用 ・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、およ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、0.00825%（税抜0.0075%）。 ・上場の年賦課金：毎年末の純資産総額に対して、0.00825%（税抜0.0075%）およびTDnet利用料。 これらは、信託財産中から支弁され、当該ETF保有期間中に間接的にご負担いただく費用となります。 （当該費用については、運用状況により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することはできません。）

※上記手数料・費用等の合計額については、投資家の皆さまがファンドを保有される期間等に応じて異なりますので、表示することはできません。

設定・運用は

シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社　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、一般社団法人第二種金融商品取引業協会

■当資料は、シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社（以下「弊社」といいます。）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していますが、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数値・図表等は、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。また、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や又、為替相場の変動等の影響を受けますが、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。また、投資成果を事前に保証するものではありません。投資信託は預貯金とは異なります。■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、運用方針及びリスク要因等、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。■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。■当資料の内容については、予告なく変更される場合があります。■当資料の無断転写、転載は出来ません。当資料の第三者への提供は固くお断りいたします。