



- PBRが1倍未満である銘柄のなかから、利益水準や財務状況、取引所における流動性等を当社独自の観点から総合的に勘案し、投資銘柄を選定することにより、投資信託財産の成長を目指して運用を行うアクティブETF(上場投資信託)です。
- 国内組成のETFであり、通常の株式と同様に全国の証券会社にてお取り扱いしています。

1. PBR1倍割れ解消推進ETFの概要

(2023年8月21日 現在)

| | | | |
|----------|------------------------|---------------------------|--------------|
| 銘柄名 | PBR1倍割れ解消推進ETF | | |
| 銘柄コード | 2080 | | |
| 計算期間(※1) | 毎年9月11日から翌年9月10日 | | |
| 分配金支払基準日 | 毎年9月10日(年1回) | | |
| 管理会社 | シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社 | | |
| 信託受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社 | | |
| 上場取引所 | 東京証券取引所 | 貸借銘柄選定 | あり(金銭・証券の貸付) |
| 売買単位 | 1口単位 | Indicative NAV/PCFの開示(※2) | あり(予定) |
| 信託報酬 | 0.9%(税込:0.99%)以内 | 上場日 | 2023/9/7(予定) |

※1 ただし、第1計算期間は、2023年9月6日から2024年9月10日までとします。

※2 Indicative NAVとは、PCF情報に現時点の株価を乗じることによって算出されるリアルタイムの推定純資産額(1口あたり)、PCFとは、管理会社よりご提供をいただいたポートフォリオ構成銘柄情報ファイルのことを指します。ここでは東証を通じて開示しているIndicative NAV/PCF情報の有無を記載しています。

2. 運用方針の概要について

主として、我が国の金融商品取引所に上場する株式に投資します。

株式への投資にあたっては、PBR(※)が1倍未満である銘柄のなかから、利益水準や有価証券報告書およびその他の開示情報、取引所における流動性等を当社独自の観点から総合的に勘案し、投資銘柄を選定します。

投資した銘柄のPBRが1倍を超えた場合、当該銘柄の株価動向やファンダメンタルズ、市場の状況などを総合的に勘案した上で保有を継続するか、売却するかを決定します。保有を継続した場合、PBR1倍を超えた状況が長期にわたって継続する銘柄を保有することがあります。

上場株式におけるPBR1倍割れの解消が大いに進んだ市場環境においては、PBRの水準ではなく、PBRの更なる上昇が見込めるような、資本コストと株価を意識した銘柄のなかから、利益水準や有価証券報告書およびその他の開示情報、取引所における流動性等を当社独自の観点から総合的に勘案し、投資銘柄を選定します。

(※)PBRとは、株価を1株当たり純資産(純資産を発行済株式数(普通株式のみ)で除したもので除したものです。株価純資産倍率ともいいます。

なお、当ファンドは、投資銘柄が資本コストを意識した経営に向かい、PBR1倍割れの銘柄のバリュエーションが改善することから生まれる収益機会に注目した戦略を取っています。ベンチマークを上回る収益の確保を図る運用ではなく、中長期の投資信託の成長を目指した運用であるため、ベンチマークを採用しません。



3. アクティブETF投資に際しての留意点

- 当ETFはアクティブETFです。従来のETFとは異なり、連動対象となる指数が存在しない商品です。
- ファンドにおける積極運用の結果、基準価額がベンチマークや相場全体の変動からでは説明できない動きをする場合があります。
- 管理会社等により日々開示されるポートフォリオ情報は、前日の基準価額算出の基礎となった情報でしかなく、当該情報から算出される一口当たり推定純資産額(インディカティブNAV)については、ETFの適正価格に常に一致するということではありません。

4. ETF情報入手一覧

- 当ETFに関するより詳細な商品概要
「シプレクスのETF専用ホームページ」 <https://www.simplexasset.com/etf/active/index.html>
- 基準価額（一口あたりの純資産額）等に関する情報
<https://www.jpx.co.jp/equities/products/etfs/base-price/index.html>

- 情報ベンダーコード

| 情報ベンダー名 | QUICK | Bloomberg | Refinitiv |
|---------|--------|----------------|-----------|
| ETFコード | 2080/T | 2080 JP Equity | 2080.T |

5. 免責事項

- 当資料は、作成時におけるETFの概要説明のみを目的としており、投資勧誘を目的としているものではなく、また金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。
- ETFは値動きのある有価証券等を投資対象としますので、組入有価証券等の価格の変動、組入有価証券等の発行会社の倒産や財務状況等の悪化、外国為替相場の変動及びその他の市場要因の影響等により、市場取引価格又は基準価額が値下がりし、それにより損失が生じることがあります。したがって、投資元本が保証されているものではありません。また、信用取引を利用する場合には、差し入れた保証金以上の損失が生ずるおそれがあります。
- ETFの売買が行われるに際しては、あらかじめお取引先の金融商品取引業者等より交付される契約締結前交付書面等の書面の内容を十分にお読みいただき、商品の性質、取引の仕組み、リスクの存在、販売手数料、信託報酬などの手数料等を十分に御理解いただいたうえで、御自身の判断と責任で行っていただきますよう、お願い申し上げます。
- 当資料は、2023年8月現在の内容です。その後、制度の改正等により、当資料に掲載した内容が予告なく変更される場合があります。また、この資料に掲載されている情報の作成には万全を期していますが、当該情報の完全性を保証するものではありません。当社は、当資料及び当資料から得た情報を利用したことにより発生するいかなる費用又は損害等の一切について責任を負いません。
- 本資料の一切の権利は当社に属しており、いかなる目的を問わず、無断複製・転載を禁じます。

<お問い合わせ>

株式会社東京証券取引所 上場推進部 | 〒103-8220 東京都中央区日本橋兜町2-1 | Tel:03-3666-0141(代)