



平成25年7月25日

各 位

発行者名: バークレイズ・バンク・ピーエルシー
(発行者コード: 20214)
代表者名: グループ財務担当取締役
クリス・ルーカス
問い合わせ先: バークレイズ証券株式会社
インベスター・ソリューション本部
古林 千明
TEL 03-4530-1678

上場ETN(発行者:バークレイズ・バンク・ピーエルシー)に関する日々の開示事項

バークレイズ・バンク・ピーエルシーを発行者として上場する以下のETN銘柄について、日々の開示事項の状況をご報告します。

上場ETN 銘柄(10銘柄)

掲載 番号	銘柄	銘柄コード	上場取引所
1	iPath® 商品指数連動受益証券発行信託 (i商品)	2021	東
2	iPath® 貴金属指数連動受益証券発行信託 (i貴金属)	2022	東
3	iPath® 産業用金属指数連動受益証券発行信託 (iメタル)	2023	東
4	iPath® エネルギー指数連動受益証券発行信託 (iエネルギー)	2024	東
5	iPath® 農産物指数連動受益証券発行信託 (iアグリ)	2025	東
6	iPath® 穀物指数連動受益証券発行信託 (i穀物)	2026	東
7	iPath® ソフト農産物指数連動受益証券発行信託 (iソフト)	2027	東
8	iPath® 畜産物指数連動受益証券発行信託 (i畜産物)	2028	東
9	iPath® VIX中期先物指数連動受益証券発行信託 (iVIX中)	2029	東
10	iPath® VIX短期先物指数連動受益証券発行信託 (iVIX短)	2030	東

※各銘柄の状況につきましては、次のページ以降をご参照下さい。なお、各銘柄名をクリックして頂くと、各銘柄の状況が表示されます。

以 上

[掲載番号1]

平成25年7月25日

各 位

発行者名: バークレイズ・バンク・ビーエルシー
 代表者名: グループ財務担当取締役
 クリス・ルーカス
 (銘柄コード: 2021)
 問い合わせ先: バークレイズ証券株式会社
 インベスター・ソリューション本部
 古林 千明
 TEL 03-4530-1678

iPath® 商品指数連動受益証券発行信託(i商品)に関する日々の開示事項

- 1 上場外国指標連動証券信託受益証券の上場受益権口数 平成25年7月24日 現在
- 100,000 口
-
- 2 外国指標連動証券の残存償還価額総額 平成25年7月24日 現在
- ※残存償還価額総額とは、通常の債券でいますところの未償還分総額に相当するものです。
 ※ここでは、外国指標連動証券の海外市場上場分も含めた総口数(112,100口)に、外国指標連動証券の一口あたりの償還価額(市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額)を乗じて計算しています。
 ※日本円への換算は、平成25年7月25日 午前10時時点で株式会社三菱東京UFJ銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値としてブルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 100.31 円)により、計算しています。
- 6,094,921.84 米ドル
- (円換算額は、611,381,610 円)
-
- 3 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額 平成25年7月24日 現在
- ※市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額を記載しています。
 ※日本円への換算は、平成25年7月25日 午前10時時点で株式会社三菱東京UFJ銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値としてブルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 100.31 円)により、計算しています。
- 54.3704 米ドル
- (円換算額は、5,454 円)
-
- 4 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額と、S&P GSCI® トータル・リターン指数の終値の変動率に係る乖離率 平成25年7月24日 現在
- ※市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額を基に乖離率を算出しています。
- 0.0017% %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\begin{array}{l} \text{外国指標連動証券の一口あたりの償還価額} \\ 54.3704 \text{ 米ドル} \end{array}}{\begin{array}{l} \text{前営業日の外国指標連動証券の一口あたり} \\ \text{の償還価額} \\ 54.9237 \text{ 米ドル} \end{array}} - \frac{\begin{array}{l} \text{S\&P GSCI}^{\text{®}} \text{ トータル・リターン指数の終値} \\ 4,877.838 \end{array}}{\begin{array}{l} \text{前営業日のS\&P GSCI}^{\text{®}} \text{ トータル・リターン} \\ \text{指数の終値} \\ 4,927.391 \end{array}} \right) \times 100\%$$

以上



[掲載番号2]

平成25年7月25日

各 位

発行者名: バークレイズ・バンク・ピーエルシー
 代表者名: グループ財務担当取締役
 クリス・ルーカス
 (銘柄コード: 2022)
 問合わせ先: バークレイズ証券株式会社
 インベスター・ソリューション本部
 古林 千明
 TEL 03-4530-1678

iPath® 貴金属指数連動受益証券発行信託(i貴金属)に関する日々の開示事項

- 1 上場外国指標連動証券信託受益証券の上場受益権口数 平成25年7月24日 現在
- 100,000 口
- 2 外国指標連動証券の残存償還価額総額 平成25年7月24日 現在
- ※残存償還価額総額とは、通常の債券でいいますところの未償還分総額に相当するものです。
 ※ここでは、外国指標連動証券の海外市場上場分も含めた総口数(103,000口)に、外国指標連動証券の一口あたりの償還価額(市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額)を乗じて計算しています。
 ※日本円への換算は、平成25年7月25日 午前10時時点で株式会社三菱東京UFJ銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値としてブルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 100.31 円)により、計算しています。
- 5,869,424.10 米ドル
 (円換算額は、 588,761,931 円)
- 3 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額 平成25年7月24日 現在
- ※市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額を記載しています。
 ※日本円への換算は、平成25年7月25日 午前10時時点で株式会社三菱東京UFJ銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値としてブルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 100.31 円)により、計算しています。
- 56.9847 米ドル
 (円換算額は、 5,716 円)
- 4 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額と、S&P GSCI® 貴金属指数トータル・リターン[®]の終値の変動率に係る乖離率 平成25年7月24日 現在
- ※市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額を基に乖離率を算出しています。
- 0.0113% %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}}{\text{前営業日の外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}} - \frac{\text{S\&P GSCI® 貴金属指数トータル・リターン[®]の終値}}{\text{前営業日のS\&P GSCI® 貴金属指数トータル・リターン[®]の終値}} \right) \times 100\%$$

56.9847 米ドル / 57.6316 米ドル - 1,662.295 / 1,681.357

以上

[掲載番号3]

平成25年7月25日

各 位

発行者名: バークレイズ・バンク・ピーエーシー
 代表者名: グループ財務担当取締役
 クリス・ルーカス
 (銘柄コード: 2023)
 問い合わせ先: バークレイズ証券株式会社
 インベスター・ソリューション本部
 古林 千明
 TEL 03-4530-1678

iPath[®] 産業用金属指数連動受益証券発行信託(iメタル)に関する日々の開示事項

- 1 上場外国指標連動証券信託受益証券の上場受益権口数 平成25年7月24日 現在
- 100,000 口
- 2 外国指標連動証券の残存償還価額総額 平成25年7月24日 現在
- ※残存償還価額総額とは、通常の債券でいいますところの未償還分総額に相当するものです。
 ※ここでは、外国指標連動証券の海外市場上場分も含めた総口数(106,000口)に、外国指標連動証券の一口あたりの償還価額(市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額)を乗じて計算しています。
 ※日本円への換算は、平成25年7月25日 午前10時時点で株式会社三菱東京UFJ銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値としてブルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 100.31 円)により、計算しています。
- 4,314,645.20 米ドル
 (円換算額は、432,802,060 円)
- 3 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額 平成25年7月24日 現在
- ※市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額を記載しています。
 ※日本円への換算は、平成25年7月25日 午前10時時点で株式会社三菱東京UFJ銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値としてブルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 100.31 円)により、計算しています。
- 40.7042 米ドル
 (円換算額は、4,083 円)
- 4 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額と、S&P GSCI[®] 産業用メタル指数トータル・リターン[®]の終値の変動率に係る乖離率 平成25年7月24日 現在
- ※市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額を基に乖離率を算出しています。
- 0.0020% %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}}{\text{前営業日の外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}} - \frac{\text{S\&P GSCI}^{\text{®}} \text{ 産業用メタル指数トータル・リターンの終値}}{\text{前営業日のS\&P GSCI}^{\text{®}} \text{ 産業用メタル指数トータル・リターンの終値}} \right) \times 100\%$$

40.7042 米ドル / 40.5640 米ドル - 1,362.724 / 1,358.003

以上

[掲載番号4]

平成25年7月25日

各 位

発行者名: バークレイズ・バンク・ピーエルシー
 代表者名: グループ財務担当取締役
 クリス・ルーカス
 (銘柄コード: 2024)
 問い合わせ先: バークレイズ証券株式会社
 インベスター・ソリューション本部
 古林 千明
 TEL 03-4530-1678

iPath[®] エネルギー指数連動受益証券発行信託 (iエネルギー)に関する日々の開示事項

- 1 上場外国指標連動証券信託受益証券の上場受益権口数 平成25年7月24日 現在
- 100,000 口
- 2 外国指標連動証券の残存償還価額総額 平成25年7月24日 現在
- ※残存償還価額総額とは、通常の債券でいいますところの未償還分総額に相当するものです。
 ※ここでは、外国指標連動証券の海外市場上場分も含めた総口数(101,000口)に、外国指標連動証券の一口あたりの償還価額(市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額)を乗じて計算しています。
 ※日本円への換算は、平成25年7月25日 午前10時時点で株式会社三菱東京UFJ銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値としてブルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 100.31 円)により、計算しています。
- 5,606,924.10 米ドル
 (円換算額は、562,430,556 円)
- 3 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額 平成25年7月24日 現在
- ※市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額を記載しています。
 ※日本円への換算は、平成25年7月25日 午前10時時点で株式会社三菱東京UFJ銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値としてブルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 100.31 円)により、計算しています。
- 55.5141 米ドル
 (円換算額は、5,569 円)
- 4 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額と、S&P GSCI[®] エネルギー指数トータル・リターン[®]の終値の変動率に係る乖離率 平成25年7月24日 現在
- ※市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額を基に乖離率を算出しています。
- 0.0021% %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}}{\text{前営業日の外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}} - \frac{\text{S\&P GSCI}^{\text{®}} \text{ エネルギー指数トータル・リターンの終値}}{\text{前営業日のS\&P GSCI}^{\text{®}} \text{ エネルギー指数トータル・リターンの終値}} \right) \times 100\%$$

55.5141 米ドル / 56.1648 米ドル - 1,123.493 / 1,136.638

以上



[掲載番号5]

平成25年7月25日

各 位

発行者名: バークレイズ・バンク・ピーエーシー
 代表者名: グループ財務担当取締役
 クリス・ルーカス
 (銘柄コード: 2025)
 問い合わせ先: バークレイズ証券株式会社
 インベスター・ソリューション本部
 古林 千明
 TEL 03-4530-1678

iPath® 農産物指数連動受益証券発行信託(iアグリ)に関する日々の開示事項

- 1 上場外国指標連動証券信託受益証券の上場受益権口数 平成25年7月24日 現在
- 100,000 口
- 2 外国指標連動証券の残存償還価額総額 平成25年7月24日 現在
- ※残存償還価額総額とは、通常の債券でいいますところの未償還分総額に相当するものです。
 ※ここでは、外国指標連動証券の海外市場上場分も含めた総口数(107,445口)に、外国指標連動証券の一口あたりの償還価額(市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額)を乗じて計算しています。
 ※日本円への換算は、平成25年7月25日 午前10時時点で株式会社三菱東京UFJ銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値としてブルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 100.31 円)により、計算しています。
- 6,110,923.63 米ドル
- (円換算額は、 612,986,749 円)
- 3 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額 平成25年7月24日 現在
- ※市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額を記載しています。
 ※日本円への換算は、平成25年7月25日 午前10時時点で株式会社三菱東京UFJ銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値としてブルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 100.31 円)により、計算しています。
- 56.8749 米ドル
- (円換算額は、 5,705 円)
- 4 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額と、S&P GSCI® 農産物指数トータル・リターンの終値の変動率に係る乖離率 平成25年7月24日 現在
- ※市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額を基に乖離率を算出しています。
- 0.0022% %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}}{\text{前営業日の外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}} - \frac{\text{S\&P GSCI® 農産物指数トータル・リターンの終値}}{\text{前営業日のS\&P GSCI® 農産物指数トータル・リターンの終値}} \right) \times 100\%$$

56.8749 米ドル / 57.5320 米ドル - 657.401 / 664.982

以上



[掲載番号6]

平成25年7月25日

各 位

発行者名: バークレイズ・バンク・ピーエーシー
 代表者名: グループ財務担当取締役
 クリス・ルーカス
 (銘柄コード: 2026)
 問い合わせ先: バークレイズ証券株式会社
 インベスター・ソリューション本部
 古林 千明
 TEL 03-4530-1678

iPath[®] 穀物指数連動受益証券発行信託(i穀物)に関する日々の開示事項

- 1 上場外国指標連動証券信託受益証券の上場受益権口数 平成25年7月24日 現在
- 100,000 口
- 2 外国指標連動証券の残存償還価額総額 平成25年7月24日 現在
- ※残存償還価額総額とは、通常の債券でいいますところの未償還分総額に相当するものです。
 ※ここでは、外国指標連動証券の海外市場上場分も含めた総口数(103,500口)に、外国指標連動証券の一口あたりの償還価額(市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額)を乗じて計算しています。
 ※日本円への換算は、平成25年7月25日 午前10時時点で株式会社三菱東京UFJ銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値としてブルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 100.31 円)により、計算しています。
- 6,235,792.20 米ドル
- (円換算額は、625,512,316 円)
- 3 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額 平成25年7月24日 現在
- ※市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額を記載しています。
 ※日本円への換算は、平成25年7月25日 午前10時時点で株式会社三菱東京UFJ銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値としてブルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 100.31 円)により、計算しています。
- 60.2492 米ドル
- (円換算額は、6,044 円)
- 4 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額と、S&P GSCI[®] 穀物指数トータル・リターンの終値の変動率に係る乖離率 平成25年7月24日 現在
- ※市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額を基に乖離率を算出しています。
- 0.0020% %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}}{\text{前営業日の外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}} - \frac{\text{S\&P GSCI[®] 穀物指数トータル・リターンの終値}}{\text{前営業日のS\&P GSCI[®] 穀物指数トータル・リターンの終値}} \right) \times 100\%$$

60.2492 米ドル / 60.9478 米ドル - 440.187 / 445.282

以上



[掲載番号7]

平成25年7月25日

各 位

発行者名: バークレイズ・バンク・ピーエールシー
 代表者名: グループ財務担当取締役
 クリス・ルーカス
 (銘柄コード: 2027)
 問い合わせ先: バークレイズ証券株式会社
 インベスター・ソリューション本部
 古林 千明
 TEL 03-4530-1678

iPath® ソフト農産物指数連動受益証券発行信託(iソフト)に関する日々の開示事項

- 1 上場外国指標連動証券信託受益証券の上場受益権口数 平成25年7月24日 現在
- 100,000 口
- 2 外国指標連動証券の残存償還価額総額 平成25年7月24日 現在
- ※残存償還価額総額とは、通常の債券でいいますところの未償還分総額に相当するものです。
 ※ここでは、外国指標連動証券の海外市場上場分も含めた総口数(102,000口)に、外国指標連動証券の一口あたりの償還価額(市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額)を乗じて計算しています。
 ※日本円への換算は、平成25年7月25日 午前10時時点で株式会社三菱東京UFJ銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値としてブルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 100.31 円)により、計算しています。
- 4,774,742.40 米ドル
- (円換算額は、478,954,410 円)
- 3 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額 平成25年7月24日 現在
- ※市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額を記載しています。
 ※日本円への換算は、平成25年7月25日 午前10時時点で株式会社三菱東京UFJ銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値としてブルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 100.31 円)により、計算しています。
- 46.8112 米ドル
- (円換算額は、4,696 円)
- 4 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額と、S&P GSCI® ソフト・コモディティ商品指数トータル・リターン[®]の終値の変動率に係る乖離率 平成25年7月24日 現在
- ※市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額を基に乖離率を算出しています。
- 0.0025% %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\begin{array}{l} \text{外国指標連動証券の一口あたりの償還価額} \\ 46.8112 \text{ 米ドル} \end{array}}{\begin{array}{l} \text{前営業日の外国指標連動証券の一口あたり} \\ \text{の償還価額} \\ 47.3457 \text{ 米ドル} \end{array}} - \frac{\begin{array}{l} \text{S\&P GSCI}^{\text{®}} \text{ ソフト・コモディティ商品} \\ \text{指数トータル・リターン} \\ \text{の終値} \\ 80.634 \end{array}}{\begin{array}{l} \text{前営業日のS\&P GSCI}^{\text{®}} \text{ ソフト・コモディティ商品} \\ \text{指数トータル・リターン} \\ \text{の終値} \\ 81.553 \end{array}} \right) \times 100\%$$

以上

[掲載番号8]

平成25年7月25日

各 位

発行者名: バークレイズ・バンク・ピーエールシー
 代表者名: グループ財務担当取締役
 クリス・ルーカス
 (銘柄コード: 2028)
 問い合わせ先: バークレイズ証券株式会社
 インベスター・ソリューション本部
 古林 千明
 TEL 03-4530-1678

iPath® 畜産物指数連動受益証券発行信託(i畜産物)に関する日々の開示事項

- 1 上場外国指標連動証券信託受益証券の上場受益権口数 平成25年7月24日 現在
- 100,000 口
- 2 外国指標連動証券の残存償還価額総額 平成25年7月24日 現在
- ※残存償還価額総額とは、通常の債券でいいますところの未償還分総額に相当するものです。
 ※ここでは、外国指標連動証券の海外市場上場分も含めた総口数(107,000口)に、外国指標連動証券の一口あたりの償還価額(市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額)を乗じて計算しています。
 ※日本円への換算は、平成25年7月25日 午前10時時点で株式会社三菱東京UFJ銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値としてブルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 100.31 円)により、計算しています。
- 5,101,481.80 米ドル
 (円換算額は、 511,729,639 円)
- 3 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額 平成25年7月24日 現在
- ※市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額を記載しています。
 ※日本円への換算は、平成25年7月25日 午前10時時点で株式会社三菱東京UFJ銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値としてブルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 100.31 円)により、計算しています。
- 47.6774 米ドル
 (円換算額は、 4,783 円)
- 4 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額と、S&P GSCI® 畜産物商品指数トータル・リターン[®]の終値の変動率に係る乖離率 平成25年7月24日 現在
- ※市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額を基に乖離率を算出しています。
- 0.0021% %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}}{47.6774 \text{ 米ドル}} - \frac{\text{S\&P GSCI}^{\text{®}} \text{ 畜産物商品指数トータル・リターンの終値}}{2,039.674} \right) \times 100\%$$

$$\left(\frac{\text{前営業日の外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}}{47.6811 \text{ 米ドル}} - \frac{\text{前営業日のS\&P GSCI}^{\text{®}} \text{ 畜産物商品指数トータル・リターンの終値}}{2,039.790} \right)$$

以上

[掲載番号9]

平成25年7月25日

各 位

発行者名: バークレイズ・バンク・ビーエルシー
 代表者名: グループ財務担当取締役
 クリス・ルーカス
 (銘柄コード: 2029)
 問い合わせ先: バークレイズ証券株式会社
 インベスター・ソリューション本部
 古林 千明
 TEL 03-4530-1678

iPath® VIX中期先物指数連動受益証券発行信託(iVIX中)に関する日々の開示事項

- 1 上場外国指標連動証券信託受益証券の上場受益権口数 平成25年7月24日 現在
- 125,000 口
-
- 2 外国指標連動証券の残存償還価額総額 平成25年7月24日 現在
- ※残存償還価額総額とは、通常の債券でいいますところの未償還分総額に相当するものです。
 ※ここでは、外国指標連動証券の海外市場上場分も含めた総口数(151,299口)に、外国指標連動証券の一口あたりの償還価額(市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額)を乗じて計算しています。
 ※日本円への換算は、平成25年7月25日 午前10時時点で株式会社三菱東京UFJ銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値としてブルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 100.31 円)により、計算しています。
- 3,660,800.34 米ドル
- (円換算額は、367,214,883 円)
-
- 3 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額 平成25年7月24日 現在
- ※市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額を記載しています。
 ※日本円への換算は、平成25年7月25日 午前10時時点で株式会社三菱東京UFJ銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値としてブルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 100.31 円)により、計算しています。
- 24.1958 米ドル
- (円換算額は、2,427 円)
-
- 4 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額と、S&P 500 VIX中期先物指数トータル・リターン¹⁾の終値の変動率に係る乖離率 平成25年7月24日 現在
- ※市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額を基に乖離率を算出しています。
- 0.0027% %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}}{24.1958 \text{ 米ドル}} - \frac{\text{S\&P 500 VIX中期先物指数トータル・リターンの終値}}{47,271.00} \right) \times 100\%$$

$$\left(\frac{\text{前営業日の外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}}{24.1748 \text{ 米ドル}} - \frac{\text{前営業日のS\&P 500 VIX中期先物指数トータル・リターンの終値}}{47,228.70} \right)$$

以上

[掲載番号10]

平成25年7月25日

各 位

発行者名: バークレイズ・バンク・ビーエルシー
 代表者名: グループ財務担当取締役
 クリス・ルーカス
 (銘柄コード: 2030)
 問い合わせ先: バークレイズ証券株式会社
 インベスター・ソリューション本部
 古林 千明
 TEL 03-4530-1678

iPath® VIX短期先物指数連動受益証券発行信託 (iVIX短)に関する日々の開示事項

- 1 上場外国指標連動証券信託受益証券の上場受益権口数 平成25年7月24日 現在
- 1,225,000 口
- 2 外国指標連動証券の残存償還価額総額 平成25年7月24日 現在
- ※残存償還価額総額とは、通常の債券でいいますところの未償還分総額に相当するものです。
 ※ここでは、外国指標連動証券の海外市場上場分も含めた総口数(2,132,697口)に、外国指標連動証券の一口あたりの償還価額(市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額)を乗じて計算しています。
 ※日本円への換算は、平成25年7月25日 午前10時時点で株式会社三菱東京UFJ銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値としてブルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 100.31 円)により、計算しています。
- 5,426,647.52 米ドル
 (円換算額は、544,347,012 円)
- 3 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額 平成25年7月24日 現在
- ※市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額を記載しています。
 ※日本円への換算は、平成25年7月25日 午前10時時点で株式会社三菱東京UFJ銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値としてブルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 100.31 円)により、計算しています。
- 2,5445 米ドル
 (円換算額は、255 円)
- 4 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額と、S&P 500 VIX短期先物指数
 トータル・リターンの終値の変動率に係る乖離率 平成25年7月24日 現在
- ※市場障害等の事由により償還価額が算定されなかった場合には、連動対象指標の終値を基に計算される参考価額を基に乖離率を算出しています。
- 0.0016% %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}}{2,5445 \text{ 米ドル}} - \frac{\text{S\&P 500 VIX短期先物指数トータル・リターンの終値}}{1,644.55} \right) \times 100\%$$

$$\left(\frac{\text{前営業日の外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}}{2,5226 \text{ 米ドル}} - \frac{\text{前営業日のS\&P 500 VIX短期先物指数トータル・リターンの終値}}{1,630.37} \right)$$

以上