



平成27年8月20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: デピュティ・グループ・ファイナンス・ディレクター
マーク・マーソン
問合わせ先: バークレイズ証券株式会社
エクイティ・ファンド・ストラクチャード・マーケツ本部
東 華七子
TEL 03-4530-1123

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 [®] 商品指數運動受益証券発行信託 (i商品) | 2021 | 東 |
| 2 | iPath [®] 貴金属指數運動受益証券発行信託 (i貴金属) | 2022 | 東 |
| 3 | iPath [®] 産業用金属指數運動受益証券発行信託 (iメタル) | 2023 | 東 |
| 4 | iPath [®] エネルギー指數運動受益証券発行信託 (iエネルギー) | 2024 | 東 |
| 5 | iPath [®] 農産物指數運動受益証券発行信託 (iアグリ) | 2025 | 東 |
| 6 | iPath [®] 穀物指數運動受益証券発行信託 (i穀物) | 2026 | 東 |
| 7 | iPath [®] ソフト農産物指數運動受益証券発行信託 (iソフト) | 2027 | 東 |
| 8 | iPath [®] 畜産物指數運動受益証券発行信託 (i畜産物) | 2028 | 東 |
| 9 | iPath [®] VIX中期先物指數運動受益証券発行信託 (iVIX中) | 2029 | 東 |
| 10 | iPath [®] VIX短期先物指數運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27年8月20日

各 位

発行者名: パークレイズ・バンク・ピーエルシー
代表者名: デビュティ・グループ・ファイナンス・ディレクター
(銘柄コード: 2021)
間合わせ先: パークレイズ証券株式会社
エクイティ・ファンド・ストラクチャード・マーケット本部
東 華七子
TEL 03-4530-1123

iPath® 商品指標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27年8月19日 現在

110,000 口

2 外国指標連動証券の残存償還価額総額 平成27年8月19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(112,980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27年8月20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フルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 123.82 円)により、計算しています。

3,210,360.59 米ドル
(円換算額は、 397,506,849 円)

3 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額 平成27年8月19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27年8月20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フルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 123.82 円)により、計算しています。

28,4153 米ドル
(円換算額は、 3,518 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27年8月19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。

-0.0023% %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[\frac{\text{外国指標連動証券の一口あたりの償還価額} - \text{前営業日の外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}}{\text{前営業日の外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}} \right] \times 100\% = \left[\frac{28,4153 - 29,0153}{29,0153} \right] \times 100\% = -2.00\%$$

以上



[掲載番号2]

平成27年8月20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: デビュティ・グループ・ファイナンス・ディレクター
マーク・マーソン
(銘柄コード: 2022)
問合せ先: バークレイズ証券株式会社
エクイティ・ファンド・ストラクチャード・マーケツ本部
東 華七子
TEL 03-4530-1123

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27年8月19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27年8月19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(100,320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27年8月20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= 123.82 円)により、計算しています。

4,698,968.74 米ドル
(円換算額は、 581,826,309 円)

3 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額 平成27年8月19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27年8月20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= 123.82 円)により、計算しています。

46.8398 米ドル
(円換算額は、 5,800 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27年8月19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

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

以上



[掲載番号3]

平成27年8月20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: デビュティ・グループ・ファイナンス・ディレクター
マーク・マーソン
(銘柄コード: 2023)
問合せ先: バークレイズ証券株式会社
エクイティ・ファンド・ストラクチャード・マーケツ本部
東 華七子
TEL 03-4530-1123

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27年8月19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27年8月19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(100,344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27年8月20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= 123.82 円)により、計算しています。

2,983,207.05 米ドル
(円換算額は、 369,380,697 円)

3 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額 平成27年8月19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27年8月20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= 123.82 円)により、計算しています。

29.7298 米ドル
(円換算額は、 3,681 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27年8月19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

$$\left(\frac{\text{外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}}{29.7298 \text{ 米ドル}} - \frac{\text{前営業日の外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}}{29.7639 \text{ 米ドル}} \right) \times \frac{\text{S&P GSCI® 産業用メタル指数トータル・リターンの終値}}{1,010.898} \times \frac{\text{前営業日のS&P GSCI® 産業用メタル指数トータル・リターンの終値}}{1,012.037} \times 100\%$$

以上



[掲載番号4]

平成27年8月20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: デビュティ・グループ・ファイナンス・ディレクター
マーク・マーソン
(銘柄コード: 2024)
問合せ先: バークレイズ証券株式会社
エクイティ・ファンド・ストラクチャード・マーケツ本部
東 華七子
TEL 03-4530-1123

iPath® エネルギー指数連動受益証券発行信託(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27年8月19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27年8月19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(100,310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27年8月20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= 123.82 円)により、計算しています。

2,354,967.84 米ドル
(円換算額は、 291,592,118 円)

3 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額 平成27年8月19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27年8月20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= 123.82 円)により、計算しています。

23.4769 米ドル
(円換算額は、 2,907 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27年8月19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

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

以上



[掲載番号5]

平成27年8月20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: デビュティ・グループ・ファイナンス・ディレクター
マーク・マーソン
(銘柄コード: 2025)
問合せ先: バークレイズ証券株式会社
エクイティ・ファンド・ストラクチャード・マーケツ本部
東 華七子
TEL 03-4530-1123

iPath® 農産物指標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27年8月19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27年8月19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(101,213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27年8月20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= 123.82 円)により、計算しています。

3,983,622.22 米ドル
(円換算額は、 493,252,104 円)

3 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額 平成27年8月19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27年8月20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= 123.82 円)により、計算しています。

39.3588 米ドル
(円換算額は、 4,873 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® 農産物指數トータル・リターンの終値の変動率に係る乖離率 平成27年8月19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。

-0.0023% %

(参考) 乖離率の計算式

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

以上



[掲載番号6]

平成27年8月20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: デビュティ・グループ・ファイナンス・ディレクター
マーク・マーソン
(銘柄コード: 2026)
問合せ先: バークレイズ証券株式会社
エクイティ・ファンド・ストラクチャード・マーケツ本部
東 華七子
TEL 03-4530-1123

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27年8月19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27年8月19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(100,111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27年8月20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= 123.82 円)により、計算しています。

4,170,544.17 米ドル
(円換算額は、 516,396,779 円)

3 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額 平成27年8月19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27年8月20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= 123.82 円)により、計算しています。

41.6592 米ドル
(円換算額は、 5,158 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27年8月19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

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

以上



[掲載番号7]

平成27年8月20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: デビュティ・グループ・ファイナンス・ディレクター
マーク・マーソン
(銘柄コード: 2027)
問合せ先: バークレイズ証券株式会社
エクイティ・ファンド・ストラクチャード・マーケツ本部
東 華七子
TEL 03-4530-1123

iPath® ソフト農産物指數連動受益証券発行信託(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27年8月19日 現在

110,000 口

2 外国指標連動証券の残存償還価額総額 平成27年8月19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(110,530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27年8月20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= 123.82 円)により、計算しています。

3,620,034.35 米ドル
(円換算額は、 448,232,653 円)

3 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額 平成27年8月19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27年8月20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= 123.82 円)により、計算しています。

32.7516 米ドル
(円換算額は、 4,055 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數トータル・リターンの終値の変動率に係る乖離率 平成27年8月19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

$$\left(\frac{\text{外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}}{\text{S&P GSCI® ソフト・コモディティ商品指數トータル・リターンの終値}} - \frac{\text{前営業日の外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}}{\text{前営業日のS&P GSCI® ソフト・コモディティ商品指數トータル・リターンの終値}} \right) \times 100\%$$

32.7516 米ドル 57.299
33.0986 米ドル 57.905

以上



[掲載番号8]

平成27年8月20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: デビュティ・グループ・ファイナンス・ディレクター
マーク・マーソン
(銘柄コード: 2028)
問合せ先: バークレイズ証券株式会社
エクイティ・ファンド・ストラクチャード・マーケツ本部
東 華七子
TEL 03-4530-1123

iPath® 畜産物指標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27年8月19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27年8月19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(100,000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27年8月20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= 123.82 円)により、計算しています。

4,870,820.00 米ドル
(円換算額は、 603,104,932 円)

3 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額 平成27年8月19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27年8月20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= 123.82 円)により、計算しています。

48.7082 米ドル
(円換算額は、 6,031 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® 畜産物商品指標トータル・リターンの終値の変動率に係る乖離率 平成27年8月19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

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

以上



[掲載番号9]

平成27年8月20日

各 位

発行者名: パークレイズ・バンク・ピーエルシー
代表者名: デビュティ・グループ・ファイナンス・ディレクター
(銘柄コード: 2029)
間合わせ先: パークレイズ証券株式会社
エクイティ・ファンド・ストラクチャード・マーケット本部
東 華七子
TEL 03-4530-1123

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27年8月19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27年8月19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(143,780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27年8月20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フルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 123.82 円)により、計算しています。

1,807,127.69 米ドル
(円換算額は、 223,758,550 円)

3 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額 平成27年8月19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27年8月20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フルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 123.82 円)により、計算しています。

12.5687 米ドル
(円換算額は、 1,556 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・リターンの終値の変動率に係る乖離率 平成27年8月19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。

-0.0029% %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[\frac{\text{外国指標連動証券の一口あたりの償還価額} - \text{前営業日の外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}}{\text{前営業日の外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}} \right] \times 100\% = \left[\frac{12.5687 - 12.4374}{12.4374} \right] \times 100\% = 3.3\%$$

以上



[掲載番号10]

平成27年8月20日

各 位

発行者名: パークレイズ・バンク・ピーエルシー
 代表者名: デビュティ・グループ・ファイナンス・ディレクター
 マーク・マーソン
 (銘柄コード: 2030)
 問合わせ先: パークレイズ証券株式会社
 エクイティ・ファンド・ストラクチャード・マーケット本部
 東 華七子
 TEL 03-4530-1123

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27年8月19日 現在

17,675,000 口

2 外国指標連動証券の残存償還価額総額

平成27年8月19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(24,198,044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27年8月20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フルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 123.82 円)により、計算しています。

16,060,241.80 米ドル
(円換算額は、 1,988,579,140 円)

3 外国指標連動証券の一口あたりの償還価額

平成27年8月19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27年8月20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フルームバーグに表示された為替レート(1米ドル= 123.82 円)により、計算しています。

0.6637 米ドル
(円換算額は、 82 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・リターンの終値に係る乖離率

平成27年8月19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。

-0.0042% %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[\frac{\text{外国指標連動証券の一口あたりの償還価額} - \text{前営業日の外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}}{\text{前営業日の外国指標連動証券の一口あたりの償還価額}} \right] \times 100\% = \left[\frac{\text{S&P 500 VIX短期先物指数トータル・リターンの終値} - \text{前営業日のS&P 500 VIX短期先物指数トータル・リターンの終値}}{\text{前営業日のS&P 500 VIX短期先物指数トータル・リターンの終値}} \right] \times 100\%$$

以上