

平成28年6月28日

各 位

管理会社名 BNPパリバ・インベストメント・パートナーズ・ルクセンブルグ
(管理会社コード 13274)
代表者名 チーフ・エグゼクティブ・オフィサー ステファン・ブルネ
(銘柄コード 1327 東証外国ETF)
問合せ先 BNPパリバ インベストメント・パートナーズ株式会社
業務本部長 杉本 祥子
(TEL:0120-996-222)

S&P GSCI商品指数®エネルギー&メタル・キャップド・コンポーネント35/20・THEAM・
イージーUCITS・ETFクラスA米ドル建受益証券に関する日々の開示事項

1. 上場ETFの上場受益権口数 (平成28年6月24日 現在)

3,661,973 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成28年6月24日 現在)

10,491,864,070.81 円 (104,127,273.43 USD)

(平成28年6月24日に三菱東京UFJ銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値1USD=100.76円で換算)

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成28年6月24日 現在)

2,865.08 円 (28.4347 USD)

(平成28年6月24日に三菱東京UFJ銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値1USD=100.76円で換算)

4. 上場ETFの一口あたりの純資産額の日々の価格の変動幅と円換算したS&P GSCI商品指数®エネルギー&メタル・キャップド・
コンポーネント35/20トータル・リターン指数の終値の日々の変動幅の乖離率 (平成28年6月24日 現在)

-0.00319 %

(参考) 乖離率の計算式は次の通りです。

$$\left(\frac{\text{基準日の上場ETFの一口あたりの純資産額}}{\text{前ファンド営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額}} - \frac{\text{基準日の円換算したS\&P GSCI商品指数\textcircled{R}エネルギー\&メタル\cdotキャップド\cdotコンポーネント35/20トータル\cdotリターン指数}}{\text{前ファンド営業日の円換算したS\&P GSCI商品指数\textcircled{R}エネルギー\&メタル\cdotキャップド\cdotコンポーネント35/20トータル\cdotリターン指数}} \right) \times 100\%$$

(X.XXXXX%まで表示 表示未満は四捨五入)