

2020年9月28日

各 位

管理会社名 BNPパリバ・アセットマネジメント・ルクセンブルク
(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・アセットマネジメント株式会社
業務部 大久保 知香
(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 (2020年9月24日 現在)

3,296,598 口

2. 上場ETFの純資産総額 (2020年9月24日 現在)

9,125,695,052.23 円 (86,540,493.62 USD)

(2020年9月24日に三菱UFJ銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値1USD=105.45円で換算)

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (2020年9月24日 現在)

2,768.22 円 (26.2515 USD)

(2020年9月24日に三菱UFJ銀行が発表した対顧客電信売・買相場の仲値1USD=105.45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 (2020年9月24日 現在)

-0.00122 %

(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)

<指数に関するリスク>

ベンチマーク指数を構成する商品先物契約においては、通常、限月間に保管コスト等を反映した価格差が生じます。

期先の先物価格が期近の先物価格を上回る場合には、当ファンドは損失を被る場合があるため中長期的な投資を行う場合には留意が必要です。