

平成26年10月23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
投信業務部長 杉本 祥子
(TEL:0120-996-222)

S&P GSCI商品指数@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26年10月21日 現在)

4,094,973 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成26年10月21日 現在)
現地通貨ベース

17,939,214,535.52 円 (167,891,572.63 USD)
(平成26年10月21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=106.85円で換算)

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成26年10月21日 現在)
現地通貨ベース

4,380.79 円 (40.9994 USD)
(平成26年10月21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=106.85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@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26年10月21日 現在)

-0.00329 %

(参考) 乖離率の計算式は次の通りです。

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

(X.XXXXX%まで表示 表示未満は四捨五入)