



平成 28 年 1 月 21 日

各 位

管理会社名 ステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニー  
(管理会社コード 15574)  
代表者 エグゼクティブ・ヴァイス・プレジデント ジェイムズ・E・ロス  
シニア・ヴァイス・プレジデント マイケル・ブレンダガスト  
エグゼクティブ・ヴァイス・プレジデント ブレンダ・ライオンズ  
(銘柄コード 1557 (東証外国 ETF))  
問合せ先 (代理人) 西村あさひ法律事務所 弁護士 伊東 啓  
(TEL. 03 - 6250 - 6200)

## SPDR® S&P500® ETF 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 1 月 20 日現在)

883,282,116 口

2. 上場 ETF の純資産総額(平成 28 年 1 月 20 日現在)

(平成 28 年 1 月 20 日に三菱東京 UFJ 銀行が発表した対顧客電信売・買相場の中値1米国ドル=117.55 で計算)

19,288,339,405,917 円 ( 164,086,256,111.59 米国ドル)

3. 上場 ETF の一口あたりの純資産額(平成 28 年 1 月 20 日現在)

(平成 28 年 1 月 20 日に三菱東京 UFJ 銀行が発表した対顧客電信売・買相場の中値1米国ドル=117.55 で計算)

21,837 円 ( 185.77 米国ドル)

4. 上場 ETF の一口あたりの純資産額の日々の変動幅と S&P500 指数の日々の変動幅との乖離率(平成 28 年 1 月 20 日現在)

0.02 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left( \frac{\begin{array}{l} \text{上場ETFの} \\ \text{一口あたりの純資産額} \end{array} + \begin{array}{l} * \text{上場ETFの} \\ \text{一口あたりの収益分配金} \end{array}}{\begin{array}{l} \text{前営業日の上場ETFの一口あたりの純資産額} \end{array}} - \frac{\begin{array}{l} \text{S\&P500指数の終値} \\ \text{前営業日の S\&P500指数の終値} \end{array}}{\begin{array}{l} \text{前営業日の S\&P500指数の終値} \end{array}} \right) \times 100 (\%)$$

(\*上場ETFの一口あたりの収益分配金は、基準日が米国取引所における分配落日に該当する場合のみ加算)

※ [www.spdrs.com/product/fund.seam?ticker=SPY](http://www.spdrs.com/product/fund.seam?ticker=SPY) でリアルタイム情報がご覧になれます。