



平成 28 年 9 月 13 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 ナンシー・M・ストークス
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 9 月 12 日現在)

911,682,116 口

2. 上場 ETF の純資産総額(平成 28 年 9 月 12 日現在)

(平成 28 年 9 月 12 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=102.64 で計算)

20,245,921,341,928 円 (197,251,766,776.38 米国ドル)

3. 上場 ETF の一口あたりの純資産額(平成 28 年 9 月 12 日現在)

(平成 28 年 9 月 12 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=102.64 で計算)

22,207 円 (216.36 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 9 月 12 日現在)

0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

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

(*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 でリアルタイム情報をご覧いただけます。