



平成 30 年 9 月 3 日

各 位

管理会社名 ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・トラスト・カンパニー  
(管理会社コード 15574)  
代表者 シニア・リプレゼンタティブ ジェイムズ・E・ロス  
シニア・リプレゼンタティブ ナンシー・M・ストークス  
シニア・リプレゼンタティブ 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 30 年 8 月 31 日現在)

947,132,116 口

2. 上場 ETF の純資産総額(平成 30 年 8 月 31 日現在)

(平成 30 年 8 月 31 日に三菱 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=111.06 で計算)

30,536,368,542,456 円 ( 274,953,795,628.09 米国ドル)

3. 上場 ETF の一口あたりの純資産額(平成 30 年 8 月 31 日現在)

(平成 30 年 8 月 31 日に三菱 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=111.06 で計算)

32,241 円 ( 290.30 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 30 年 8 月 31 日現在)

0.01 %

(参考) 乖離率の計算式

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

(\*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](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。