

平成29年7月19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 インベストメント・パートナーズ株式会社  
業務本部 塘口 貴子  
(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 (平成29年7月17日 現在)

3,599,476 口

2. 上場ETFの純資産総額 (平成29年7月17日 現在)

11,448,410,033.00 円 (100,840,394.90 USD)

(平成29年7月14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=113.53円で換算)

3. 上場ETFの一口あたりの純資産額 (平成29年7月17日 現在)

3,180.58 円 (28.0153 USD)

(平成29年7月14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=113.53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 (平成29年7月17日 現在)

-0.00715 %

(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)