

令和元年8月26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 リン・ブレイク
シニア・リプレゼンタティブ バリー・スミス
シニア・リプレゼンタティブ スコット・エブナー
(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 (令和元年8月23日 現在)

894,332,116 口

2. 上場 ETF の純資産総額 (令和元年8月23日 現在)

(令和元年8月23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 = 106.66 で計算)

27,159,381,330,043 円 (254,635,114,663.82 米国ドル)

3. 上場 ETF の一口あたりの純資産額 (令和元年8月23日 現在)

(令和元年8月23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 = 106.66 で計算)

30,368 円 (284.72 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 (令和元年8月23日 現在)

0.01 %

(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がご覧になれます。