

2022年3月2日

各位

会社名 野村アセットマネジメント株式会社
(管理会社コード 13064)
代表者名 CEO 兼代表取締役社長 小池 広靖
問い合わせ先 サポートダイヤル 長坂 智
TEL 0120-753104

「NEXT FUNDS ロシア株式指数・RTS 連動型上場投信」の

基準価額と市場価格の重要な乖離について

当社で運用を行なっている「NEXT FUNDS ロシア株式指数・RTS 連動型上場投信」(以下、「当 ETF」といいます)(銘柄コード:1324)について、基準価額と東京証券取引所における市場価格(終値)との間に重要な乖離が発生していることをお知らせいたします。

[対象 ETF (括弧内は銘柄コード)]

NEXT FUNDS ロシア株式指数・RTS 連動型上場投信 (1324)

[乖離の状況とその要因]

本日(3月2日)の東京証券取引所における市場価格(終値)が当 ETF の基準価額(一口あたりの純資産額)を大きく上回る水準となり重要な乖離が発生しました。

基準価額(一口あたり)	市場価格(終値)	乖離率
100.88 円	122.0 円	20.9%

2022年3月2日現在

一般的に、市場価格は、取引所における売買を通じて基準価額に収れんしていく傾向がありますが、当 ETF に関しては、需給の影響によって市場価格と基準価額との間に乖離が発生していると考えられます。

[投資判断上ご留意頂きたい点]

ロシア株式の取引を行なうことが困難となっていることなどを背景に、2022年2月24日以降の申込に関して、当 ETF の設定および解約の申込の受付を停止しておりますが、東京証券取引所における当 ETF の売買は、引き続き通常通り行なわれる予定です。

ただし、設定および解約の申込の受付の停止により、当 ETF の東京証券取引所における基準価額と市場価格がさらに乖離する可能性があります。当 ETF を売買する際には、基準価額と市場価格の乖離に十分にご注意下さい。

また、信託財産に組み入れている銘柄の調整売買ができなくなる場合は、基準価額と対象指数との連動性が低下する場合があります。

今後も、ウクライナ情勢の先行きの見通しが極めて不透明であるため、基準価額や東京証券取引所における市場価格の値動きが大きくなる可能性があります。

2月28日以降、モスクワ取引所における株式取引は行なわれておりません。ロシア中央銀行はモスクワ取引所の株式取引を3月2日も再開しないことを発表しており、3月3日の営業時間については同日の現地時間午前9時（日本時間午後3時）までに発表する予定となっております。

投資家の皆様におかれましては、以上ご留意の上ご投資いただきますよう何卒よろしくお願い申し上げます。

なお、基準価額は下記ウェブサイトにおいて、毎営業日公表されています。
当社ホームページ：<https://nextfunds.jp/lineup/1324/>

以 上