

2022年3月8日

各 位

管理会社名 ブラックロック・ジャパン株式会社
代表者名 代表取締役社長 有田 浩之
問合せ先 ETF事業部 東條 健一
(TEL.03-6703-4278)

ロシア関連の株式・債券保有状況のお知らせ

ブラックロック・ジャパン株式会社を管理会社として上場する下記ETF 3 銘柄について、ロシア関連の株式・債券保有状況をお知らせいたします。

銘柄コード	銘柄名	保有資産	連動対象指数
1658	iシェアーズ・コア MSCI 新興国株 ETF	株式	M S C I エマージング・マーケット IMI 指数 (国内投信用 円建て)
2622	iシェアーズ 米ドル建て新興国債券 ETF (為替ヘッジあり)	債券	J.P. モルガン EMBI グローバルコア インデックス 国内投信用 (円建て、円ヘッジ)
2623	iシェアーズ ユーロ建て投資適格社債 ETF (為替ヘッジあり)	債券	ブルームバーグ・ユーロ社債インデックス TTM (為替ヘッジ有り、円ベース)

ロシア取引所の閉鎖、外国人投資家によるロシア証券売却の一時禁止等により、ブラックロックを含むグローバル投資家はロシアの証券投資の売買が困難であることから、2月28日付で弊社ETFはロシアの証券の買い付けを停止しております。

一方、当該 ETF は原則として上記の法令を遵守しながら指数プロバイダーの方針に準拠します。当該 ETF の連動対象指数からロシア株式は 3 月 9 日、ロシア債券は、3 月 31 日の取引終了時に除外される旨、公表されました。連動対象指数からの除外に伴うロシア証券の売却は、現状の環境下では、困難です。

当該 ETF の実質的な投資にあたっては、ブラックロックが運用する海外上場 ETF を活用しており、投資先 ETF の基準価額のロシア株式、債券の評価はフェア・バリュー（公正価値）に基づき、評価されています。この基準価額の評価方法は、連動対象指数と異なる場合があることから、連動対象指数と基準価額の乖離が生じる可能性があります。

2月25日および、3月7日時点での連動対象指数におけるロシア株式、債券の構成比率と、当該ETFの基準価額の評価ベースの実質的保有比率は下記の通りです。

銘柄コード	保有資産	2月25日		3月7日	
		連動対象指数	ETF実質組入比率	連動対象指数	ETF実質組入比率
1658	株式	2.02%	2.01%	1.28%	0.00%
2622	債券	2.53%	2.51%	0.67%	0.64%
2623	債券	0.01%	0.01%	0.00%	0.00%

以上