

2022年3月8日

各位

日興アセットマネジメント株式会社
代表取締役社長 佐谷戸淳一
問合せ先 ETFビジネス開発部 花村憲治
(TEL. 03-6447-6449)

「上場インデックスファンド新興国債券」の当面の運用に関するお知らせ

平素は弊社ETFをご愛顧賜り、誠にありがとうございます。

さて、「上場インデックスファンド新興国債券」（以下、「当ETF」といいます）（銘柄コード：1566）の当面の運用についてお知らせいたします。

当ETFは円換算したブルームバーグ自国通貨建て新興市場国債・10%国キャップ・インデックス（対象指数）の変動率に一致させることをめざす運用を行なっております。

3月4日時点での当ETFにおけるロシア債券の実質的な保有比率は0.39%となっております。

過去1か月間の対象指数と当ETFの騰落率の差（乖離率）は以下の通りです。

日付	乖離率
2022/2/4	-0.01%
2022/2/7	-0.02%
2022/2/8	0.01%
2022/2/9	-0.01%
2022/2/10	-0.01%
2022/2/14	0.01%
2022/2/15	-0.01%
2022/2/16	-0.02%
2022/2/17	0.01%
2022/2/18	0.03%
2022/2/21	0.03%
2022/2/22	-0.03%
2022/2/24	-0.08%
2022/2/25	0.08%
2022/2/28	0.07%
2022/3/1	-1.47%
2022/3/2	-0.27%
2022/3/3	-0.44%
2022/3/4	0.27%

対象指数と当ETFの騰落率の差（乖離率）の主な要因は、指数算出に適用される時価評価と当ETFの保有資産に適用される時価評価が異なり、主にロシア国債の評価価格に乖離が出たためです。

ロシア債券は3月末の取引終了時に対象指数から除外される予定となっております。

対象指数からロシア国債が除外された後、当ETFで保有しているロシア債券の売却をすることができず、

対象指数と基準価額の乖離要因となる可能性があります。

投資家の皆様におかれましては、以上の点にご留意の上、ご投資いただきますようお願い申し上げます。

※当 ETF に関する情報につきましては、以下の弊社 ETF ウェブサイトをご参照下さい。

<https://www.nikkoam.com/products/etf/lineup/bcem>

以上

■ 当資料は、日興アセットマネジメントが「上場インデックスファンド新興国債券」の当面の運用に関するお知らせについてお伝えすることを目的として作成した資料であり、特定ファンドの勧誘資料ではありません。