

2022年3月15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」の値動き等について

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)の値動きならびに投資判断上ご留意頂きたい点について、お知らせいたします。

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いても、当ETFについて、3月16日まで売買を行い、3月17日から当面の間、売買を停止する旨が発表されております。

東京証券取引所において売買が停止されて以降は、当面の間、換金を行なうことが困難となることが想定されるため、十分ご注意ください。

本日(3月15日)の東京証券取引所における市場価格(終値)と当ETFの基準価額(一口あたりの純資産額)は以下の通りとなりました。

基準価額(一口あたり)	市場価格(終値)
103.07円	90.0円

2022年3月15日現在

上記基準価額に関し、モスクワ取引所の上場銘柄の株価については以下のとおりの取扱いとしております。

モスクワ取引所の上場銘柄に関しては、現地2月28日以降の取引が停止となっております。現状はモスクワ取引所の取引停止により、株式市場の流動性が無く、最終取引からも時間が経過しております。当社は、モスクワ取引所上場銘柄の評価にあたり、取引環境の変化を考慮した推定値等を参照するのではなく、これまでと同様に取引所の取引再開を前提に、現地2月25日の時価(米ドルベース)を引き続き採用して基準価額を算出しております。

そのため、モスクワ取引所の取引が再開した場合は、基準価額が大きく下落する可能性があります。また、上記方法による基準価額の算出が将来も継続されるかどうかは、今後の現地の状況および情報を踏まえた上での総合的な判断となります。モスクワ取引所の取引が再開しない場合でも、信託財産の評価ルール(一般社団法人投資信託協会の「投資信託財産の評価及び計理等に関する規則」)に基づき信託財産に組み入れている銘柄の評価を変更した場合には、基準価額が大きく下落する可能性があります。加えて、主要な株式市場指数提供会社からは、3月中に主要なグローバル株式指数からのロシア株式の除外や指数算定株価を引き下げることが発表されています。

設定および解約の申込の受付の停止により、当 ETF の基準価額と東京証券取引所における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。

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。

- ※ この他、当 ETF に関する詳細は、当社の NEXT FUNDS 専用ウェブサイトおよび当 ETF ウェブサイトをご参照下さい。

<https://nextfunds.jp/lineup/1324/>

<https://www.nomura-am.co.jp/fund/funddetail.php?fundcd=141324>

- ※ PCF に関しては、日本取引所グループの下記ウェブサイトをご参照下さい。

<http://tse.factsetdigitalsolutions.com/iopv/table?language=jp>

PCF における各銘柄の時価は、前営業日の当 ETF の基準価額算出に用いられた時価が表示されています。

モスクワ取引所の上場銘柄に関しては、現地 2 月 28 日以降の取引が停止となっているため、現地 2 月 25 日の時価（米ドルベース）を採用していますが、モスクワ取引所以外の取引所に上場している DR（預託証券）などの代替投資銘柄は、当該代替投資銘柄の時価を反映しております。

以 上