

2022年4月25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」

ロシア株式の評価について

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)が保有するロシア株式(DR(預託証券)を含みます)(以下、「ロシア株式等」といいます)の評価について、お知らせいたします。

ロシアによるウクライナへの軍事侵攻を受けた米欧による制裁措置およびロシアによる対抗措置等により、ロシア関連資産について、引き続き非居住者による取引が困難な状況が継続しております。

当社では、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、ロシア株式等について、取引所の再開を前提に知りうる直近の日の最終相場を採用して評価を行なってまいりました。しかしながら、非居住者による取引が困難な状況が一定期間継続しており、現在も再開の見通しは立っておりません。上記状況を総合的に勘案した結果、ファンド監査人と協議の上、現時点で換金できる見込みが立っていないことから、ロシア株式等の評価価格をゼロとすることが妥当と判断いたしました。

これを受け、当ETFが組み入れているロシア株式等において、本日4月25日以降の評価価格をゼロとすることといたしました。ロシア株式等の評価価格をゼロとしたことにより、本日の当ETFの基準価額(一口あたりの純資産額)は1.88円となりました。

今後、ロシア株式等の非居住者による取引の再開、市場の流動性の回復、ならびにロシア株式等に係る証券決済や為替取引の実現等の変化があれば、状況を総合的に判断の上、その評価を再度変更する可能性があります。評価を変更する際は、改めてお知らせいたします。

※ 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。

以 上