

2022年3月7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7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
100.23円	120.1円	19.8%

2022年3月7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。

また、基準価額について、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)を採用しております。それ以降の評価を反映した時価が採用されていないため、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。

[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いても、今後の市場環境等を踏まえ、当ETFの売買が停止となる可能性もありますので、十分にご留意ください。

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。3月7日および3月8日はロシアの休日であり、モスクワ取引所における株式取引は行なわれない予定です。

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