

2022年3月16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

東京証券取引所における売買の停止、値動きおよび信託報酬の引き下げについて

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)の東京証券取引所における売買の停止、値動きおよび信託報酬の引き下げについて、お知らせいたします。

[東京証券取引所における売買の停止について]

明日(3月17日)から当面の間、当ETFは東京証券取引所において売買停止となります。東京証券取引所における売買の再開は、現時点では未定です。

なお、設定および解約の申込についても、ロシア株式の取引を行なうことが困難となってしまうことなどを背景に、2022年2月24日以降の申込に関して受付を停止しております。

東京証券取引所において売買が停止されてからも、当ETFの基準価額は、当社のNEXT FUNDS 専用ウェブサイトおよび当ETFウェブサイトにおいて公表されます。

[当ETFの値動きについて]

本日(3月16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)
103.14 円	88.6 円

2022年3月16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J)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、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の引き下げが発表されています。

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い場合は、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。

[信託報酬の引き下げについて]

設定・解約の受付や東京証券取引所における売買の再開に関する見通しが不透明であり、信託財産に組み入れている銘柄の売却などもできないという状況であることを踏まえ、このような状況が改善されるまでは、2022年3月17日以降当面の間、当ETFの信託報酬を下記の通り変更いたします。

(2022年3月16日まで) 税抜年0.95%

(2022年3月17日以降) 税抜年0.06%

※設定・解約の受付や東京証券取引所における売買の再開など状況が改善した場合には、税抜年0.95%の信託報酬に変更する予定です。

※ 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