

2022年3月28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）の基準価額等について、お知らせいたします。

モスクワ取引所の株式の取引に関しては、現地2月28日以降の取引が停止となっていました。が、現地3月24日に一部銘柄の取引が再開されました。また、ロシア中央銀行は現地3月28日より全銘柄の取引を再開することを発表しました。

しかし、引き続き非居住者による売買は困難な状況が継続しているため、当ETFの設定および解約の申込の受付の再開は現時点では未定です。設定および解約の申込の受付の再開については改めてお知らせいたします。

また、当ETFは東京証券取引所においても引き続き売買停止となっており、売買の再開は、現時点では未定です。

[当ETFの基準価額等について]

本日（3月28日）の当ETFの基準価額（一口あたりの純資産額）は3.4%下落し、89.33円となりました。一方で、日本円換算したRTS指数（対象株価指数）は2.6%下落しました。基準価額と対象株価指数の下落率の差の主な要因は、評価に用いている為替の時点の差異と現地3月25日に取引が再開されていない銘柄の評価価格の差異によるものです。

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。

現地3月25日に取引された銘柄については現地3月25日の時価（米ドルベース）を採用しております。

また、現地3月25日に取引が再開されていない銘柄については、これまでは最終相場である現地2月25日の時価（米ドルベース）を採用していましたが、ロシア株式市場（RTS指数）が大きく変動しているため、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、本日は取引環境やロシア株式市場の価格の変化を考慮した推定値を採用して基準価額を算出しております。

モスクワ取引所の取引について、一部銘柄の取引が再開されておりますが、引き続き非居住者による売買は困難な状況が継続しております。

非居住者の取引なども含めて全面的に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非居住者の取引なども含めて全面的に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、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。

- ※ 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