

2022年3月4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 新興国株式・MSCI エマージング・マーケット・インデックス

(為替ヘッジなし) 連動型上場投信」の当面の運用に関するお知らせ

「NEXT FUNDS 新興国株式・MSCI エマージング・マーケット・インデックス (為替ヘッジなし) 連動型上場投信」(以下、「当ETF」といいます)(銘柄コード: 2520)の当面の運用についてお知らせいたします。

当ETFは日本円換算したMSCI エマージング・マーケット・インデックス(対象株価指数)に連動する投資成果を目指して運用を行なっておりますが、対象株価指数を算出するMSCIは3月9日の取引終了時にロシア株式を除外することを発表しました。

3月3日時点での対象株価指数におけるロシア株式の構成比率と当ETFにおけるロシア株式の実質的な保有比率は以下の通りです。

対象株価指数	当ETF
1.7%	0.5%

2月28日以降モスクワ取引所におけるロシア株式の取引は行なわれておらず、ロシア株式の取引を行なうことが困難となっておりますが、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の価格が下落していることなどにより上記の比率に差異が発生しています。

また、対象株価指数からロシア株式が除外された後も実質的に信託財産に組み入れているロシア株式の売却をすることができず、対象株価指数と基準価額の乖離要因となる可能性があります。当ETFは、引き続き対象株価指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

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/2520/>

<https://www.nomura-am.co.jp/fund/funddetail.php?funded=142520>

※ 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。

ロシア株式については、モスクワ取引所の上場銘柄に関して、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