

2022年3月9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 新興国債券・J.P.モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・

インデックス・プラス（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 新興国債券・J.P.モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（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：2519）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 J.P.モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（対象指数）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、対象指数を算出する J.P. Morgan Securities LLC は 3 月 31 日の取引終了時にロシア債券を指数から除外する方針を発表しました。

当ETFは、引き続き対象指数に連動する投資成果を意識しつつ、流動性等注視して適切な運用を行ないませんが、制裁等の影響でロシア国債の売買が困難な状況であるため、対象指数からロシア国債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国債の売却をすることができず、対象指数と基準価額の乖離要因となる可能性があります。

3月8日時点での対象指数におけるロシア国債の構成比率と当ETFにおけるロシア国債の実質的な保有比率は以下の通りです。

対象指数	当ETF
1.9%	2.3%

指数算出の評価時価と当ETFの保有資産の評価時価が異なること等から、両者の比率に差異が発生しています。

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/2519/>

<https://www.nomura-am.co.jp/fund/funddetail.php?funded=142519>

※ 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