

2022年3月8日

各位

日興アセットマネジメント株式会社
代表取締役社長 佐谷戸 淳一
問合せ先 ETFビジネス開発部 花村 憲治
(TEL. 03-6447-6449)

「上場インデックスファンド世界株式 (MSCI ACWI) 除く日本」の当面の運用に関

するお知らせ

平素は弊社ETFをご愛顧賜り、誠にありがとうございます。

さて、「上場インデックスファンド世界株式 (MSCI ACWI) 除く日本」(以下、「当ETF」といいます)(銘柄コード: 1554)の当面の運用についてお知らせいたします。

当ETFは円換算したMSCI ACWI ex Japan インデックスの変動率に一致させることを目指して運用を行っております。

3月4日時点での当ETFにおけるロシア株式の実質的な保有比率(DR(預託証書)などの代替運用を含む)は0.02%となっております。

過去1か月間の対象指数と当ETFの騰落率の差(乖離率)は以下の通りです。

日付	対象指数と当ETFの騰落率の差
2022/2/4	-0.01%
2022/2/7	0.00%
2022/2/8	0.00%
2022/2/9	-0.01%
2022/2/10	0.01%
2022/2/14	-0.02%
2022/2/15	0.02%
2022/2/16	0.00%
2022/2/17	0.01%
2022/2/18	-0.01%
2022/2/21	0.00%
2022/2/22	0.02%
2022/2/24	-0.04%
2022/2/25	0.02%
2022/2/28	0.05%
2022/3/1	-0.11%
2022/3/2	-0.05%
2022/3/3	-0.03%
2022/3/4	0.03%

対象指数と当 ETF の騰落率の差（乖離率）の主な要因は、DR（預託証券）など当 ETF の運用においてロシア株式の代替運用をしている投資対象と対象指数に組み入れられているロシア株式の時価に差が発生しているため（一部期間でロシア株式が取引停止となっている）です。

ロシア株式は3月9日の取引終了時に対象指数から除外される予定となっております。

対象指数からロシア株式が除外された後、当 ETF で保有している DR（預託証券）などを売却することができず、対象指数と当 ETF の基準価額の乖離要因となる可能性があります。

投資家の皆様におかれましては、以上の点にご留意の上、ご投資いただきますようお願い申し上げます。

※当 ETF に関する情報につきましては、以下の弊社 ETF ウェブサイトをご参照下さい。

<https://www.nikkoam.com/products/etf/lineup/msci-all>

以上

■ 当資料は、日興アセットマネジメントが「上場インデックスファンド世界株式（MSCI ACWI）除く日本」の当面の運用に関するお知らせについてお伝えすることなどを目的として作成した資料であり、特定ファンドの勧誘資料ではありません。