

2026年4月7日

各 位

農林中金全共連アセットマネジメント株式会社

(管理会社コード 15954)

代表者名 代表取締役社長 八木 正展

問合せ先 プロダクトガバナンス部 組成開示グループ

田原 輝行

(TEL. 03-5210-8692)

弊社ETFの基準価額と市場価格の重要な乖離についてのお知らせ

平素は弊社ETFをご愛顧賜り、厚く御礼申し上げます。

弊社で運用を行う「NZAM 上場投信 海外債券 (FTSE WGBI 除く日本) (為替ヘッジなし) (銘柄コード: 539A)」について、基準価額と東京証券取引所における市場価格 (終値) との間に重要な乖離が発生していることをお知らせいたします。

記

1. 対象ETF

NZAM 上場投信 海外債券 (FTSE WGBI 除く日本) (為替ヘッジなし) (銘柄コード: 539A)

2. 乖離状況と要因

対象ETFについては、以下のとおり基準価額と東京証券取引所における市場価格 (終値) との間に20%以上の乖離が発生しております。

NZAM 上場投信 海外債券 (FTSE WGBI 除く日本) (為替ヘッジなし) (銘柄コード: 539A)

	基準価額 (一口あたり)	市場価格 (終値)	基準価額と市場価格の 乖離率
4月6日	4,981.67 円	6,101.00 円	22.47%

本乖離の発生要因については、当ETFの取引所での取引量が低調となったなか、基準価額と市場価格との間に重要な乖離 (突発的な乖離) が発生したものと考えられます。

3. 今後の見込み

一般的に、E T Fの市場価格は、需給によって取引所で売買が行われることで、基準価額に収斂していく傾向にあります。当E T Fについては、取引所での取引量が低調に推移した場合、重要な乖離が継続することも想定されます。

投資家の皆さまにおかれましては、以上をご留意いただき、今後ともご愛顧賜りますよう、何卒よろしくお願い申し上げます。

以 上