

2026年3月23日

各 位

管理会社名 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 東証REIT指数(2・5・8・11月決算型)」(銘柄コード:530A)、「NZAM 上場投信 先進国株式(MSCI-KOKUSAI)(為替ヘッジなし)」(銘柄コード:536A)および「NZAM 上場投信 全世界株式(MSCI ACWI)(為替ヘッジなし)」(銘柄コード:537A)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ご知らせいたします。

記

1. 対象ETF

NZAM 上場投信 東証REIT指数(2・5・8・11月決算型)(銘柄コード:530A)

NZAM 上場投信 先進国株式(MSCI-KOKUSAI)(為替ヘッジなし)(銘柄コード:536A)

NZAM 上場投信 全世界株式(MSCI ACWI)(為替ヘッジなし)(銘柄コード:537A)

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 東証REIT指数(2・5・8・11月決算型)(銘柄コード:530A)

	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
3月19日	1,975.70円	2,376.00円	20.26%

NZAM 上場投信 先進国株式 (MSCI-KOKUSAI) (為替ヘッジなし) (銘柄コード: 536A)

	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
3月19日	1,981.76 円	2,500.00 円	26.15%

NZAM 上場投信 全世界株式 (MSCI ACWI) (為替ヘッジなし) (銘柄コード: 537A)

	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
3月19日	992.45 円	1,199.00 円	20.81%

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、ETF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ETF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、何卒よろしくお願ひ申し上げます。

以 上