

2026年3月24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 S&P500(為替ヘッジなし)」(銘柄コード:533A)、「NZAM 上場投信 NASDAQ100(為替ヘッジなし)」(銘柄コード:534A)、「NZAM 上場投信 DAX(為替ヘッジなし)」(銘柄コード:535A)、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お知らせいたします。

### 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 S&P500(為替ヘッジなし)(銘柄コード:533A)
- NZAM 上場投信 NASDAQ100(為替ヘッジなし)(銘柄コード:534A)
- NZAM 上場投信 DAX(為替ヘッジなし)(銘柄コード:535A)
- 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 23 日	1,935.11 円	2,873.00 円	48.47%

NZAM 上場投信 S&P500 (為替ヘッジなし) (銘柄コード: 533A)

	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 23 日	1,941.84 円	2,731.00 円	40.64%

NZAM 上場投信 NASDAQ100 (為替ヘッジなし) (銘柄コード: 534A)

	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 23 日	1,932.86 円	2,695.00 円	39.43%

NZAM 上場投信 DAX (為替ヘッジなし) (銘柄コード: 535A)

	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 23 日	1,891.32 円	2,310.00 円	22.14%

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 23 日	967.22 円	1,194.00 円	23.45%

本乖離の発生要因については、当 E T F 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、何卒よろしくお願ひ申し上げます。

以 上