

2022年3月14日

投資家の皆さまへ

ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社

弊社が設定・運用するファンドで保有する
ロシアの株式ならびに預託証券等の評価時価について

拝啓 時下ますますご清祥のこととお慶び申し上げます。

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、弊社が設定、運用するファンドが保有しているロシア株式ならびに預託証券等(以下「ロシア株式等」といいます。)の評価時価についてご説明いたします。

現在、多くのロシア株式等について、ファンドの基準価額算出に使用する評価時価には対円での為替変動のみが反映されており、ロシア株式等の市場実勢が反映されておられません。

2月28日(現地時間)以降、ロシアの証券取引所は株式取引の停止を継続しております。また、米国や英国等の海外市場もロシア株式等の取引を相次いで停止いたしました。このように市場の流動性が大幅に低下している中、実勢を反映した時価の取得が困難な状況となっております。

今後ロシア株式等の取引が再開した場合等には、その時点での市場価格で評価が行われるため、ロシア株式等を保有している一部のファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。

一方、ロシア株式等は外貨建(ルーブル建や米ドル建等)であることから、ファンドの基準価額は対円での為替変動の影響を受けます。

なお、ロシア株式等を保有する一部のファンドについては、2022年2月28日以降ご購入・ご換金のお申込みの受付を停止しております(定時定額のご購入等、自動買付分のお取引も含みます。)。これは、上記の通り市場での取引が事実上困難であり、個別銘柄の適正な評価時価が取得できない中、ファンドとしての流動性が十分に担保できず、投資家の皆さまの間での公平性を保てない可能性がある等の理由から、投資信託約款に基づき判断したものです。ロシア株式等を保有するファンドのうちお申込みの受付を停止しているファンド、ならびに自動買付分のお取引については、下記ご参照下さい。

投資家の皆さまには、ご迷惑をお掛けいたしますが、何卒ご理解、ご了承のほど、宜しく願い申し上げます。

敬具

記

<ロシア株式等を保有するファンドのうちお申込みの受付を停止しているファンド>

- ドイツ・ロシア東欧株式ファンド

<自動買付分のお取引>

- 確定拠出年金に係る設定・解約・買換え
- 累積投資契約、積立投資契約等の定時定額購入の設定
- 分配金の再投資による設定
- 変額年金保険契約による設定、解約

以上