

2022年3月14日
HSBCアセットマネジメント株式会社

ご投資家の皆さまへ

弊社設定ファンドのロシア株式時価評価に関するお知らせ

拝啓 時下益々ご清祥のこととお喜び申し上げます。平素より格別のご高配を賜り、厚く御礼申し上げます。

現在、ロシア株式は、ロシアによるウクライナの侵攻の影響を受けて市場は閉鎖され、ほとんど取引ができない状態になっております。このような環境下、弊社設定ファンドにおけるロシア株式については、投資信託協会が定める規則に従い、知りうる直近の日の最終価格を評価額として基準価額を計算しておりますが、株式の価格はほとんど更新されておらず、評価額が実勢を反映していると言い難い状況にあります。同規則においては、このような状況が一定期間経過した場合は運用会社が合理的と判断する評価額を使用することができることとなっております。

事態の発生より一定期間が過ぎ、さらに長期化が予想される状況を鑑み、弊社では現状の評価額の使用を続けることは適切でないという判断に至り、3月14日算出の基準価額から該当するファンドに関しまして、下記の通りの評価額を使用することといたしました。

なお、弊社設定ファンドの運用委託先でもある弊社グループの運用会社の運用する外国籍投資信託においても同様の時価評価が行われており、弊社設定ファンドのうち弊社グループの運用する外国籍投資信託に投資を行うファンドオブファンズ形式のものでは既にその評価が反映されたものとなっております。

今後の動向によって変更等が生じる場合には、改めてお知らせいたします。ご理解、ご了承のほど、宜しくお願い申し上げます。一刻も早い事態の収束を社員一同願っております。

敬具

記

種別	評価額
ロシア株式	直近の基準価額算出において使用した評価値が2月28日の基準価額算出において使用した評価値の10%未満となっているものについては、その評価値を使用する。それ以外のものについては一律2月28日の基準価額算出において使用した評価値の10%とする(すべて外貨ベース*)。ただし、継続して取引され、実勢を反映していると思われる評価値がある銘柄についてはその評価値を採用する。

*基準価額算出における為替レートに関しては通常通り算出日のレートを用いる。

影響を受ける主なファンド*

HSBC ロシア オープン (現在、ご購入・ご換金のお申込み受付停止中)

*HSBC BRICsオープン、HSBC 新 BRICsファンドについては投資対象となっている外国投信においてすでに合理的と考えられる評価額が用いられており、それに基づいた当該外国投信の価格を評価額として用いています。世界の株式に投資を行うHSBC世界資源エネルギーオープンにおいてもロシア株式が投資対象となっており、上記の評価額を適用しますが、組入れ比率は低く大きな影響はございません。これらのファンドは通常通りご購入・ご換金のお申込みを受け付けております。

以上