2026年9月28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 米国国債7-10年（為替ヘッジなし）」（銘柄コード：538A）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 米国国債7-10年（為替ヘッジなし）（銘柄コード：538A）

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 米国国債7-10年（為替ヘッジなし）（銘柄コード：538A）

	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
9月28日	4,706.48円	7,933.00円	68.55%

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、何卒よろしくお願い申し上げます。

以　上