

2018年5月11日

各 位

委託会社名	日興アセットマネジメント株式会社 (管理会社コード：13084)
代表者名	代表取締役社長 柴田拓美
問い合わせ先	ETF開発部 今井幸英 (TEL.03-6447-6581)

「上場インデックスファンド Nifty50 先物 (インド株式)」  
監理銘柄 (審査中) への指定および上場廃止予定のお知らせ

当社が設定・運用しております「上場インデックスファンド Nifty50 先物 (インド株式)」(以下、当ETFといたします。)(証券コード1549)は、主要投資対象である「インド株式インデックスファンド(適格機関投資家向け)」を通じ、シンガポール証券取引所上場の「Nifty50 指数先物」を実質的な投資対象として、信託財産の1口あたりの純資産額の変動率を、対象指標である円換算した「Nifty50 指数先物」(Nifty50 指数を原資産とする、シンガポール証券取引所におけるNifty50 指数先物の直近限月の清算値を指します。)の変動率に一致させることを目指して運用しております。

このたび、当ETFは東京証券取引所において監理銘柄(審査中)に指定され、上場廃止となる予定でございますので、お知らせいたします。

記

1. 当ETFを取り巻く環境と今後の対応について

- 2018年4月24日に開示いたしました『「上場インデックスファンドNifty50先物 (インド株式)」シンガポール証券取引所におけるNifty50指数先物の上場廃止について』にてご案内の通り、当ETFが実質的に投資対象としているシンガポール証券取引所上場の「Nifty50 指数先物」は、2018年6月1日を最終取引日として2018年6月4日に上場廃止となることが決定しております。
- このまま特段の環境変化なく、2018年6月4日にシンガポール証券取引所上場の「Nifty50 指数先物」に係る取引が廃止された場合、当ETFの信託約款第44条第2項において「Nifty50指数先物に係る取引が廃止された場合、委託者は受託者と合意の上、この信託契約を解約し、信託を終了させます。」といった旨を規定していることから、当社では、受益者の皆様に対する書面決議の手続きを行なうことなく当ETFを信託終了し繰上償還させる方針です。
- 当社は、当ETFの今後の対応方針を議論する中で、運用を継続させるための対応策も検討いたしました。当ETFの対象指標の変更は投資信託及び投資法人に関する法律に規定される重大な内容と考えるため、受益者の皆様に対する書面決議の手続きが必要となり、2018年6月4日までに約款変更を完了させることは断念せざるを得ないと判断いたしました。2018年6月4日に「Nifty50指数先物」に係る取引が廃止された場合、当ETFを繰上償還させる方針であることから、必然的に当ETFの対象指標の変更は行なえなくなります。

- こうしたことから、当社は東京証券取引所との間で、当E T Fの上場廃止に向けた協議を行ない、当該適時開示をもって「監理銘柄（審査中）」への指定を受けることとなりましたので、お知らせ申し上げます。
- 今後、当社は、シンガポール証券取引所上場の「Nifty50指数先物」に係る取引が廃止となる2018年6月4日に当E T Fの繰上償還を決定し、同日から東京証券取引所において整理銘柄に指定される予定となっております。東京証券取引所における当E T Fの最終取引日は2018年6月14日、上場廃止日は2018年6月15日を予定しております。最終的に、当E T Fは2018年6月19日を信託終了日として繰上償還とする予定です。償還金の支払いにつきましては、信託終了予定日である2018年6月19日現在の受益者名簿に記録されている受益者に対し、2018年7月27日から支払いを開始する予定です。
- 信託終了時受益者に交付する金銭の額は、信託終了時の基準価額（信託終了時の純資産総額を受益権総口数で除した額をいいます。）に、当該信託終了時受益者に属する受益権の口数を乗じた額とし、必要に応じて税金等が差し引かれます。
- なお、可能性が低いことではございますが、当E T Fが実質的に投資対象としているシンガポール証券取引所上場の「Nifty50指数先物」について、2018年6月4日の上場廃止が撤回された場合、上述の当E T Fの信託約款第44条第2項に規定された繰上償還事由に該当しないこととなるため、当社は当E T Fの運用を継続する方針です。

## 2. 当E T Fの今後の運用について

- 当社は、当E T Fの信託約款に定める「運用の基本方針」に則った運用をできる限り継続したいと考えている一方で、実質的な投資対象であるシンガポール証券取引所上場の「Nifty50指数先物」に係る取引が廃止となる極めて異例の事態に直面しており、投資家保護の観点から、繰上償還に備えた運用停止の投資行動は、最終取引日である2018年6月1日より前に実施することが望ましいと判断いたしました。
- 具体的には、繰上償還に備えた資金化を2018年5月25日に行なう方針で、2018年5月28日以降、当E T Fの基準価額は対象指標の値動きに連動しないこととなる予定ですので、お含み置き下さい。
- なお、市場の混乱等により、2018年5月25日にシンガポール証券取引所上場の「Nifty50指数先物」に係る取引が解消できず、運用停止の措置が取れなかった場合は、その後、速やかに解消できるよう努める方針です。

## 3. 今後の予定スケジュール

2018年5月11日(金)	東京証券取引所における監理銘柄（審査中）への指定（予定）
2018年6月4日(月)	シンガポール証券取引所上場の「Nifty50指数先物」廃止（予定） 当E T Fの繰上償還決定（予定） 東京証券取引所における整理銘柄への指定（予定）
2018年6月14日(木)	東京証券取引所における最終取引日（予定）
2018年6月15日(金)	東京証券取引所における上場廃止日（予定）
2018年6月19日(火)	当E T Fの信託終了日（予定）
2018年7月27日(金)	当E T Fの償還金支払開始日（予定）

以上