

2022年3月10日

受益者のみなさま

三菱UFJ国際投信株式会社

短期ロシアルーブル債オープン（毎月分配型）の基準価額下落の背景について

拝啓 時下益々ご清祥のこととお慶び申し上げます。

平素は当社投資信託に格別のご高配を賜り、厚く御礼申し上げます。

ロシアのウクライナ侵攻を受けた米欧の経済制裁やそれに対抗措置をロシアが設けたことにより、取引の規制、決済機構やSWIFTからの除外による取引後の受渡が行えない状況となったほか、利金や償還金の受取制限などが掛かり、市場でのロシア国債等の取引が成立しない状況となりました。

このため、ロシアルーブル建て債券（以下、「当該債券」）の評価価格において、組入債券評価の入手先として定めている主力価格情報会社が2022年3月9日より算出不可となり、主力価格情報会社以外の価格情報会社においても同様の状況となっています。

さらには、ロシアへの経済制裁等の影響に伴い、当該債券は市場において売買および決済が行われておらず、ロシアルーブルの日本円への換金の見込みは立っておりません。

投資信託財産の評価及び計理等に関する規則等や会計基準に基づきますと、組入有価証券に係る評価は換金可能な価格である必要があり、ファンド監査人と協議の上、上記状況を総合的に勘案した結果、現時点で換金できる見込みが立っていないことから、当該債券の評価価格をゼロとすることが妥当と判断いたしました。

これを受け、当社ファンドの「短期ロシアルーブル債オープン（毎月分配型）」が組み入れている当該債券において、本日3月10日以降の評価価格をゼロとすることといたしました。

これらの決定に従い、「短期ロシアルーブル債オープン（毎月分配型）」の3月10日の基準価額（1万口当たり）は397円（前日比-50.44%）となりました。

今後、当該債券の取引の再開、市場の流動性の回復、価格情報会社の価格算出が再開される等の変化があれば、状況を総合的に判断の上、その評価をゼロから回復させる可能性もあります。

本件の趣旨についてご理解賜りますとともに、今後とも当社投資信託をご愛顧のほど、よろしくお願い申し上げます。

敬具

・ 本お知らせに関するお問い合わせ

三菱UFJ国際投信 お客さま専用フリーダイヤル 0120-151034

【受付時間／9：00～17：00（土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）】

・ 受益者さまの個別のお取引内容についてのお問い合わせ

お取引のある販売会社の本支店へお問い合わせください。