

【表紙】

【提出書類】	臨時報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2022年5月20日提出
【ファンド名】	H S B C ロシア オープン
【発行者名】	H S B C アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 金子 正幸
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋三丁目11番1号
【事務連絡者氏名】	松永 七生子
【連絡場所】	東京都中央区日本橋三丁目11番1号
【電話番号】	代表（03）3548-5690
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【臨時報告書の提出理由】

「H S B C ロシア オープン」（以下「当ファンド」といいます。）につき、当ファンドの財政状態、経営成績およびキャッシュ・フローの状況に著しい影響を与える事象が発生しましたので、金融商品取引法第24条の5第4項および特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令第29条第2項第12号の規定に基づき、本臨時報告書を提出するものです。

2【報告内容】

イ．当該事象の発生年月日

2022年3月14日

ロ．当該事象の内容

ロシアによるウクライナの侵攻の影響を受けて、非居住者はロシア株式についてほとんど取引ができない状態が続いております。

当社では、当ファンドがマザーファンドを通じて実質的に組み入れているロシア株式について、一般社団法人投資信託協会の「投資信託財産の評価及び計理等に関する規則」に従い、可能な限り直近の日の組入れ銘柄の最終価格を評価額として基準価額の算出を行ってきました。しかし、評価額はほとんどが更新されず、保有する株式の評価が実勢を反映しているとは言い難い状況になりました。

このため当社では、2022年3月14日に保有株式の評価の大幅な切り下げ(実質90%切り下げ)を行い、さらに2022年3月15日にルール建てローカル株式の100% 切り下げを行いゼロ評価といたしました。

ハ．当該事象の損益に与える影響額

ロシア株式等の時価評価方法の変更を行う前営業日の2022年3月11日、時価評価方法の変更を最初に行った2022年3月14日および再度時価評価方法の変更を行った2022年3月15日の各日に算出された当ファンドの基準価額は以下の通りとなります。

2022年3月11日：2,627円

2022年3月14日：1,212円

2022年3月15日：1,051円