

【表紙】

【提出書類】	臨時報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年 5 月25日
【ファンド名】	DWS ロシア・ルーブル債券投信（毎月分配型） DWS ロシア・ルーブル債券投信（年2回決算型）
【発行者名】	ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 石谷 洋章
【本店の所在の場所】	東京都千代田区永田町二丁目11番 1 号 山王パークタワー
【事務連絡者氏名】	出仙 学恭
【連絡場所】	東京都千代田区永田町二丁目11番 1 号 山王パークタワー
【電話番号】	03(5156)5000
【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】

「DWS ロシア・ルーブル債券投信（毎月分配型）」（以下「毎月分配型」といいます。）及び「DWS ロシア・ルーブル債券投信（年2回決算型）」（以下「年2回決算型」といい、「毎月分配型」と「年2回決算型」を総称して「当ファンド」といいます。）について、財政状態、経営成績及びキャッシュ・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項及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号の規定に従い、本臨時報告書を提出することといたしました。

2【報告内容】

イ 当該事象の発生年月日

2022年5月9日

ロ 当該事象の内容

当ファンドが主要投資対象とするDWS ロシア・ルーブル債券投信・マザーファンドで保有しているDWS ロシア・ボンド・ファンドの評価を、当ファンドの2022年5月9日時点の基準価額算出時より、管理会社が実態に即して算出した水準に変更いたしました。

当ファンドの基準価額の算出には、前営業日のDWS ロシア・ボンド・ファンドの基準価額を使用しますが、ロシアの債券市場について、妥当性のある個別債券の時価評価が出来ないこと等から、DWS ロシア・ボンド・ファンドは2022年2月25日を最後に基準価額の発表を停止しています。このため、2022年3月1日以降、当ファンドの基準価額には2022年2月25日時点のDWS ロシア・ボンド・ファンドの基準価額を使用し、ロシア債券市場の価格変動が反映されない状況が続いていました。

しかし、ロシアの債券市場が平常の状態に戻る目処は立っておらず、DWS ロシア・ボンド・ファンドの基準価額の発表再開時期も未定であること等を受け、当ファンドの監査法人ならびにDWS ロシア・ボンド・ファンドの管理会社と協議し、DWS ロシア・ボンド・ファンドの評価を当ファンドの2022年5月9日時点の基準価額算出時より、管理会社が実態に即して算出した水準に変更いたしました。

なお、DWS ロシア・ボンド・ファンドの評価を管理会社が実態に即して算出した水準に変更するにあたっては、保有する債券等について2022年4月22日時点で評価を行い、ロシア・ルーブル建のロシア国債等は実質ゼロ評価としました。また、ロシア・ルーブル以外の通貨建の債券については管理会社により2022年4月22日の水準で評価しています。

ハ 当該事象の損益に与える影響額

DWS ロシア・ボンド・ファンドの評価の変更を行った2022年5月9日及びその前営業日（2022年5月6日）の各日に算出された当ファンドの基準価額（1万口当りの純資産総額）は以下の通りです。

	毎月分配型	年2回決算型
2022年5月6日（変更前）	3,169円	10,019円
2022年5月9日（変更後）	303円	958円

以上