

各位

発行者名 ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・ブイ
 (発行者コード: 20314)
 代表者名 社長兼業務執行取締役 室町 博之
 問合せ先 野村証券株式会社
 ETFビジネス企画室
 野村 正明 TEL 03-3211-1811

上場ETN (発行者: ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・ブイ) に関する日々の開示事項

ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・ブイを発行者として上場する以下のETN 銘柄について、日々の開示事項の状況をご報告します。

上場ETN 銘柄 (23 銘柄)

| 掲載番号 | 銘柄 | 銘柄コード | 上場取引所 |
|------|--|-------|-------|
| 1 | NEXT NOTES 香港ハンセン・ダブル・ブルETN | 2031 | 東 |
| 2 | NEXT NOTES 香港ハンセン・ベアETN | 2032 | 東 |
| 3 | NEXT NOTES 韓国KOSPI・ダブル・ブルETN | 2033 | 東 |
| 4 | NEXT NOTES 韓国KOSPI・ベアETN | 2034 | 東 |
| 5 | NEXT NOTES 日経平均VI先物指数ETN | 2035 | 東 |
| 6 | NEXT NOTES 日経・TOCOM 金 ダブル・ブルETN | 2036 | 東 |
| 7 | NEXT NOTES 日経・TOCOM 金 ベアETN | 2037 | 東 |
| 8 | NEXT NOTES 日経・TOCOM 原油 ダブル・ブルETN | 2038 | 東 |
| 9 | NEXT NOTES 日経・TOCOM 原油 ベアETN | 2039 | 東 |
| 10 | NEXT NOTES NYダウ・ダブル・ブル・ドルヘッジETN | 2040 | 東 |
| 11 | NEXT NOTES NYダウ・ベア・ドルヘッジETN | 2041 | 東 |
| 12 | NEXT NOTES 東証マザーズETN | 2042 | 東 |
| 13 | NEXT NOTES STOXX アセアン好配当50 (円、ネットリターン) ETN | 2043 | 東 |
| 14 | NEXT NOTES S&P500 配当貴族(ネットリターン) ETN | 2044 | 東 |
| 15 | NEXT NOTES S&P シンガポール リート(ネットリターン) ETN | 2045 | 東 |
| 16 | NEXT NOTES インドNifty・ダブル・ブルETN | 2046 | 東 |
| 17 | NEXT NOTES インドNifty・ベアETN | 2047 | 東 |
| 18 | NEXT NOTES 野村日本株高配当70 (ドルヘッジ、ネットリターン) ETN | 2048 | 東 |
| 19 | NEXT NOTES 日本株配当貴族 (ドルヘッジ、ネットリターン) ETN | 2065 | 東 |
| 20 | NEXT NOTES 東証REIT (ドルヘッジ、ネットリターン) ETN | 2066 | 東 |
| 21 | NEXT NOTES 野村AIビジネス70 (ネットリターン) ETN | 2067 | 東 |
| 22 | NEXT NOTES 高ベータ30 (ネットリターン) ETN | 2068 | 東 |
| 23 | NEXT NOTES 低ベータ50 (ネットリターン) ETN | 2069 | 東 |

※各銘柄の状況につきましては、次のページ以降をご参照下さい。なお、各銘柄名をクリックして頂くと、各銘柄の状況が表示されます。

以上

[掲載番号 1]

各 位

発 行 者 名 ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・フアイ
(銘柄コード: 2031)
代 表 者 名 社長兼業務執行取締役 室町 博之
問 合 せ 先 野 村 證 券 株 式 会 社
E T F ビ ジ ネ ス 企 画 室
野 村 正 明 TEL 03-3211-1811

NEXT NOTES 香港ハンセン・ダブル・ブルETNに関する日々の開示事項

1. 上場 ETN 信託受益証券の上場受益権口数 (令和1年6月17日 現在)
260,000 口
2. ETN の残存償還価額総額 (令和1年6月17日 現在)
3,096,340,000 円
3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和1年6月17日 現在)
11,909 円
4. ETN の一証券あたりの償還価額と円換算したハンセン指数・レバレッジインデックスの終値の変動率に係る乖離率
(令和1年6月17日 現在)
0.00 %

※日本円の換算は、令和1年6月17日ロンドン時間午後4時頃に発表される日本円/米ドルの WM ロイター仲値と香港ドル/米ドルの WM ロイター仲値から算出した為替レート (1 香港ドル=13.872 円) により、計算しています。

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{ETN の一証券あたりの償還価額}}{\text{前営業日の ETN の一証券あたりの償還価額}} - \frac{\text{円換算したハンセン指数・レバレッジインデックスの終値}}{\text{前営業日の円換算したハンセン指数・レバレッジインデックスの終値}} \right) \times 100 (\%)$$

11,909 円 / 11,800 円 - 270,223 円 / 267,744 円

5. 連動対象指標の特徴と留意点

ハンセン指数・レバレッジインデックス (以下、「対象指標」といいます。) は、日々の騰落率が、香港ハンセン指数 (プライス・リターン) (以下、「原指数」といいます。) の騰落率の 2 倍として計算される指数です。ただし、2 営業日以上離れた期間における対象指標の騰落率は、一般に原指数の 2 倍とはならず、計算上、差 (ずれ) が不可避に生じます。2 営業日以上離れた期間における対象指標の騰落率と原指数の騰落率の 2 倍との差 (ずれ) は、当該期間中の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、原指数の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差 (ずれ) が生じる可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差 (ずれ) が大きくなる傾向があります。

したがって、本商品は、一般的に長期間の投資には向かず、比較的短期間の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品です。また、原指数は、配当を加味していない株価指数であり、配当を加味した株価指数に比して配当落ち分だけ減価します。

以上

[掲載番号 2]

各 位

発 行 者 名 ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・フアイ
(銘柄コード: 2032)
代 表 者 名 社長兼業務執行取締役 室町 博之
問 合 せ 先 野 村 證 券 株 式 会 社
E T F ビ ジ ネ ス 企 画 室
野 村 正 明 TEL 03-3211-1811

NEXT NOTES 香港ハンセン・ベア ETN に関する日々の開示事項

1. 上場 ETN 信託受益証券の上場受益権口数 (令和1年6月17日 現在)
60,000 口
2. ETN の残存償還価額総額 (令和1年6月17日 現在)
376,860,000 円
3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和1年6月17日 現在)
6,281 円

4. ETN の一証券あたりの償還価額と円換算したハンセン指数・ショートインデックスの終値の変動率に係る乖離率
(令和1年6月17日 現在)
※日本円の換算は、令和1年6月17日 ロンドン時間午後4時頃に発表される日本円/米ドルの WM ロイター仲値と香港ドル/米ドルの WM ロイター仲値から算出した為替レート (1 香港ドル=13.872 円) により、計算しています。
0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{ETN の一証券あたりの償還価額}}{\text{前営業日の ETN の一証券あたりの償還価額}} - \frac{\text{円換算したハンセン指数・ショートインデックスの終値}}{\text{前営業日の円換算したハンセン指数・ショートインデックスの終値}} \right) \times 100 (\%)$$

| | |
|---------|----------|
| 6,281 円 | 69,301 円 |
| 6,297 円 | 69,466 円 |

5. 連動対象指標の特徴と留意点

ハンセン指数・ショートインデックス (以下、「対象指標」といいます。)は、日々の騰落率が、香港ハンセン指数 (トータル・リターン) (以下、「原指数」といいます。)の騰落率の-1 倍として計算される指数です。ただし、2 営業日以上離れた期間における対象指標の騰落率は、一般に原指数の-1 倍とはならず、計算上、差 (ずれ) が不可避に生じます。2 営業日以上離れた期間における対象指標の騰落率と原指数の騰落率の-1 倍との差 (ずれ) は、当該期間中の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、原指数の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差 (ずれ) が生じる可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差 (ずれ) が大きくなる傾向があります。

したがって、本商品は、一般的に長期間の投資には向かず、比較的短期間の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品です。

以上

[掲載番号 3]

各 位

発 行 者 名 ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・フアイ
 (銘柄コード: 2033)
 代 表 者 名 社長兼業務執行取締役 室町 博之
 問 合 せ 先 野 村 證 券 株 式 会 社
 E T F ビ ジ ネ ス 企 画 室
 野 村 正 明 TEL 03-3211-1811

NEXT NOTES 韓国 KOSPI・ダブル・ブル ETN に関する日々の開示事項

1. 上場 ETN 信託受益証券の上場受益権口数 (令和1年6月17日 現在)
 60,000 口
2. ETN の残存償還価額総額 (令和1年6月17日 現在)
 519,360,000 円
3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和1年6月17日 現在)
 8,656 円
4. ETN の一証券あたりの償還価額と円換算した韓国総合株価指数 200 レバレッジインデックスの終値の変動率に係る乖離率
 (令和1年6月17日 現在)
 0.00 %

※日本円の換算は、令和1年6月17日ロンドン時間午後4時頃に発表される日本円/米ドルの WM ロイター仲値と韓国ウォン/米ドルの WM ロイター仲値から算出した為替レート (1 韓国ウォン=0.09159 円) により、計算しています。

(参考) 乖離率の計算式

| | | |
|--------------------------------|--|-------------------|
| ETN の一証券あたりの償還価額 8,656 円 | $\frac{\text{円換算した韓国総合株価指数 200 レバレッジインデックスの終値}}{\text{前営業日の円換算した韓国総合株価指数 200 レバレッジインデックスの終値}}$ | $\times 100 (\%)$ |
| 前営業日の ETN の一証券あたりの償還価額 8,672 円 | $\frac{20.60 \text{ 円}}{20.64 \text{ 円}}$ | |

5. 連動対象指標の特徴と留意点

韓国総合株価指数 200 レバレッジインデックス (以下、「対象指標」といいます。) は、日々の騰落率が、韓国総合株価指数 200 (プライス・リターン) (以下、「原指数」といいます。) の騰落率の 2 倍として計算される指数です。ただし、2 営業日以上離れた期間における対象指標の騰落率は、一般に原指数の 2 倍とはならず、計算上、差 (ずれ) が不可避に生じます。2 営業日以上離れた期間における対象指標の騰落率と原指数の騰落率の 2 倍との差 (ずれ) は、当該期間中の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、原指数の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差 (ずれ) が生じる可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差 (ずれ) が大きくなる傾向があります。

したがって、本商品は、一般的に長期間の投資には向かず、比較的短期間の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品です。また、原指数は、配当を加味していない株価指数であり、配当を加味した株価指数に比して配当落ち分だけ減価します。

以上

[掲載番号 4]

各 位

| | |
|---------|--|
| 発 行 者 名 | ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・フ・イ (銘柄コード: 2034) |
| 代 表 者 名 | 社 長 兼 業 務 執 行 取 締 役 室 町 博 之 |
| 問 合 せ 先 | 野 村 證 券 株 式 会 社 E T F ビ ジ ネ ス 企 画 室 野 村 正 明 TEL 03-3211-1811 |

NEXT NOTES 韓国 KOSPI・ベア ETN に関する日々の開示事項

- | | |
|---|-----------------|
| 1. 上場 ETN 信託受益証券の上場受益権口数 | (令和1年6月17日 現在) |
| | 150,000 口 |
| 2. ETN の残存償還価額総額 | (令和1年6月17日 現在) |
| | 1,526,550,000 円 |
| 3. ETN の一証券あたりの償還価額 | (令和1年6月17日 現在) |
| | 10,177 円 |
| 4. ETN の一証券あたりの償還価額と円換算した韓国総合株価指数 200 (先物)・インバースインデックスの終値の変動率に係る乖離率 (令和1年6月17日 現在) | |

※日本円の換算は、令和1年6月17日 ロンドン時間午後4時頃に発表される日本円/米ドルの WM ロイター仲値と韓国ウォン/米ドルの WM ロイター仲値から算出した為替レート (1 韓国ウォン=0.09159 円) により、計算しています。

0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

| | | |
|--|--|-------------------|
| ETN の一証券あたりの償還価額 <div style="text-align: right; margin-right: 10px;">10,177 円</div> <hr style="border: 0; border-top: 1px solid black; margin: 5px 0;"/> 前営業日の ETN の一証券あたりの償還価額 <div style="text-align: right; margin-right: 10px;">10,175 円</div> | $\frac{\text{円換算した韓国総合株価指数 200 (先物)・インバースインデックスの終値}}{\text{前営業日の円換算した韓国総合株価指数 200 (先物)・インバースインデックスの終値}}$ | $\times 100 (\%)$ |
| | 円換算した韓国総合株価指数 200 (先物)・インバース インデックスの終値 77.88 円 | |
| | 前営業日の円換算した韓国総合株価指数 200 (先物)・インバース インデックスの終値 77.87 円 | |

5. 連動対象指標の特徴と留意点

韓国総合株価指数 200 (先物)・インバースインデックス (以下、「対象指標」といいます。)は、日々の騰落率が、韓国総合株価指数 200 (先物) (以下、「原指数」といいます。)の騰落率の-1 倍として計算される指数です。ただし、2 営業日以上離れた期間における対象指標の騰落率は、一般に原指数の-1 倍とはならず、計算上、差 (ずれ) が不可避に生じます。2 営業日以上離れた期間における対象指標の騰落率と原指数の騰落率の-1 倍との差 (ずれ) は、当該期間中の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、原指数の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差 (ずれ) が生じる可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差 (ずれ) が大きくなる傾向があります。

したがって、本商品は、一般的に長期間の投資には向かず、比較的短期間の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品です。

以上

[掲載番号 5]

各 位

発 行 者 名 ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・フイー
(銘柄コード: 2035)
代 表 者 名 社長兼業務執行取締役 室町 博之
問 合 せ 先 野 村 證 券 株 式 会 社
E T F ビ ジ ネ ス 企 画 室
野 村 正 明 TEL 03-3211-1811

NEXT NOTES 日経平均 VI 先物指数 ETN に関する日々の開示事項

1. 上場 ETN 信託受益証券の上場受益権口数 (令和1年6月17日 現在)
1,395,000 口
2. ETN の残存償還価額総額 (令和1年6月17日 現在)
1,262,475,000 円
3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和1年6月17日 現在)
905 円
4. ETN の一証券あたりの償還価額と日経平均ボラティリティー・インデックス先物指数の終値の変動率に係る乖離率 (令和1年6月17日 現在)
0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{ETN の一証券あたりの償還価額}}{\text{前営業日の ETN の一証券あたりの償還価額}} - \frac{\text{日経平均ボラティリティー・インデックス先物指数の終値}}{\text{前営業日の日経平均ボラティリティー・インデックス先物指数の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

| | | | |
|------------------------|-------|---------------------------------|-------|
| ETN の一証券あたりの償還価額 | 905 円 | 日経平均ボラティリティー・インデックス先物指数の終値 | 733 円 |
| 前営業日の ETN の一証券あたりの償還価額 | 927 円 | 前営業日の日経平均ボラティリティー・インデックス先物指数の終値 | 751 円 |

5. 連動対象指標と本商品の値動きに関する留意点

本商品は、「日経平均ボラティリティー・インデックス」(以下、「原指数」といいます。)ではなく、「日経平均ボラティリティー・インデックス先物指数」(以下、「対象指標」といいます。)への連動を目指しており、その価値は、仮に本商品が原指数への連動を目指していた場合に有していたであろう価値を下回るおそれがあります。ただし原指数は理論的に計算された指標であり、取引可能な指標ではありません。

また本商品が連動を目指す対象指標は、この指標を計算する元となる日経平均 VI 先物の限月間に通常、価格差があるため、本商品の満期時または償還時に支払われる金額が、その価格差がなかった場合と比べて、減少する可能性があります。したがって、本商品は、一般的に長期間の投資には向かず、比較的短期間の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品です。

以上

各 位

発行者名 ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・フイー
 (銘柄コード: 2036)
 代表者名 社長兼業務執行取締役 室町 博之
 問合せ先 野村証券株式会社
 ETF ビジネス 企画室
 野村 正明 TEL 03-3211-1811

NEXT NOTES 日経・TOCOM 金 ダブル・プル ETNに関する日々の開示事項

- | | |
|---|-----------------|
| 1. 上場 ETN 信託受益証券の上場受益権口数 | (令和1年6月17日 現在) |
| | 250,000 口 |
| 2. ETN の残存償還価額総額 | (令和1年6月17日 現在) |
| | 2,563,000,000 円 |
| 3. ETN の一証券あたりの償還価額 | (令和1年6月17日 現在) |
| | 10,252 円 |
| 4. ETN の一証券あたりの償還価額と日経・東商取金レバレッジ指数の終値の変動率に係る乖離率 | (令和1年6月17日 現在) |
| | 0.00 % |

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{ETN の一証券あたりの償還価額}}{\text{前営業日の ETN の一証券あたりの償還価額}} - \frac{\text{日経・東商取金レバレッジ指数の終値}}{\text{前営業日の日経・東商取金レバレッジ指数の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

| | |
|----------|----------|
| 10,252 円 | 16,572 円 |
| 10,314 円 | 16,671 円 |

5. 連動対象指標の特徴と留意点

日経・東商取金レバレッジ指数（以下、「対象指標」といいます。）は、日々の騰落率が、日経・東商取金指数（以下、「原指数」といいます。）の騰落率の 2 倍として計算される指数です。ただし、2 営業日以上離れた期間における対象指標の騰落率は、一般に原指数の 2 倍とはならず、計算上、差（ずれ）が不可避に生じます。

2 営業日以上離れた期間における対象指標の騰落率と原指数の騰落率の 2 倍との差（ずれ）は、当該期間中の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、原指数の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差（ずれ）が生じる可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差（ずれ）が大きくなる傾向があります。

対象指標は、商品先物取引の価格をもとに計算されており、商品の現物価格とは直接、連動しません。また先物取引には期限（限月）があるため、対象指標の計算においては、中心限月から翌限月への先物取引の乗り換え（「ロールオーバー」といいます。）が組み込まれており、その価格差等は対象指標の値に反映されます。仮に翌限月の先物価格が中心限月に比べて高いときは、商品現物を保有した場合に比べて、その価格差等がコスト要因となります。

したがって、本商品は、一般的に長期間の投資には向かず、比較的短期間の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品です。

以上

[掲載番号 8]

各 位

発 行 者 名 ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・フイー
(銘柄コード: 2038)
代 表 者 名 社長兼業務執行取締役 室町 博之
問 合 せ 先 野 村 證 券 株 式 会 社
E T F ビ ジ ネ ス 企 画 室
野 村 正 明 TEL 03-3211-1811

NEXT NOTES 日経・TOCOM 原油 ダブル・ブル ETNに関する日々の開示事項

1. 上場 ETN 信託受益証券の上場受益権口数 (令和1年6月17日 現在)
20,000,000 口
2. ETN の残存償還価額総額 (令和1年6月17日 現在)
24,360,000,000 円
3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和1年6月17日 現在)
1.218 円
4. ETN の一証券あたりの償還価額と日経・東商取原油レバレッジ指数の終値の変動率に係る乖離率 (令和1年6月17日 現在)
0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{ETN の一証券あたりの償還価額}}{\text{前営業日の ETN の一証券あたりの償還価額}} - \frac{\text{日経・東商取原油レバレッジ指数の終値}}{\text{前営業日の日経・東商取原油レバレッジ指数の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

| | | | |
|------------------------|---------|-------------------------|---------|
| ETN の一証券あたりの償還価額 | 1,218 円 | 日経・東商取原油レバレッジ指数の終値 | 1,723 円 |
| 前営業日の ETN の一証券あたりの償還価額 | 1,209 円 | 前営業日の日経・東商取原油レバレッジ指数の終値 | 1,711 円 |

5. 連動対象指標の特徴と留意点

日経・東商取原油レバレッジ指数（以下、「対象指標」といいます。）は、日々の騰落率が、日経・東商取原油指数（以下、「原指数」といいます。）の騰落率の 2 倍として計算される指数です。ただし、2 営業日以上離れた期間における対象指標の騰落率は、一般に原指数の 2 倍とはならず、計算上、差（ずれ）が不可避に生じます。

2 営業日以上離れた期間における対象指標の騰落率と原指数の騰落率の 2 倍との差（ずれ）は、当該期間中の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、原指数の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差（ずれ）が生じる可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差（ずれ）が大きくなる傾向があります。

対象指標は、商品先物取引の価格をもとに計算されており、商品の現物価格とは直接、連動しません。また先物取引には期限（限月）があるため、対象指標の計算においては、中心限月から翌限月への先物取引の乗り換え（「ロールオーバー」といいます。）が組み込まれており、その価格差等は対象指標の値に反映されます。翌限月の先物価格が中心限月に比べて高いときは、商品現物を保有した場合に比べて、その価格差等がコスト要因となります。

したがって、本商品は、一般的に長期間の投資には向かず、比較的短期間の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品です。

以上

各 位

発行者名 ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・フーズ
 (銘柄コード: 2039)
 代表者名 社長兼業務執行取締役 室町 博之
 問合せ先 野村証券株式会社
 ETFビジネス企画室
 野村 正明 TEL 03-3211-1811

NEXT NOTES 日経・TOCOM 原油 ベア ETNに関する日々の開示事項

- 1. 上場 ETN 信託受益証券の上場受益権口数 (令和1年6月17日 現在)
700,000 口
- 2. ETN の残存償還価額総額 (令和1年6月17日 現在)
5,552,400,000 円
- 3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和1年6月17日 現在)
7,932 円
- 4. ETN の一証券あたりの償還価額と日経・東商取原油インバース指数の終値の変動率に係る乖離率 (令和1年6月17日 現在)
0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{ETN の一証券あたりの償還価額}}{\text{前営業日の ETN の一証券あたりの償還価額}} - \frac{\text{日経・東商取原油インバース指数の終値}}{\text{前営業日の日経・東商取原油インバース指数の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

7,932 円
4,955 円
7,962 円
4,973 円

5. 連動対象指標の特徴と留意点

日経・東商取原油インバース指数（以下、「対象指標」といいます。）は、日々の騰落率が、日経・東商取原油指数（以下、「原指数」といいます。）の騰落率の-1 倍として計算される指数です。ただし、2 営業日以上離れた期間における対象指標の騰落率は、一般に原指数の-1 倍とはならず、計算上、差（ずれ）が不可避に生じます。

2 営業日以上離れた期間における対象指標の騰落率と原指数の騰落率の-1 倍との差（ずれ）は、当該期間中の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、原指数の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差（ずれ）が生じる可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差（ずれ）が大きくなる傾向があります。

対象指標は、商品先物取引の価格をもとに計算されており、商品の現物価格とは直接、連動しません。また先物取引には期限（限月）があるため、対象指標の計算においては、中心限月から翌限月への先物取引の乗り換え（「ロールオーバー」といいます。）が組み込まれており、その価格差等は対象指標の値に反映されます。翌限月の先物価格が中心限月に比べて低いときは、商品現物を空売りした場合に比べて、その価格差等がコスト要因となります。

したがって、本商品は、一般的に長期間の投資には向かず、比較的短期間の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品です。

以上

各 位

発 行 者 名 ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・フイー
(銘柄コード: 2040)
代 表 者 名 社長兼業務執行取締役 室町 博之
問 合 せ 先 野 村 證 券 株 式 会 社
E T F ビ ジ ネ ス 企 画 室
野村 正明 TEL 03-3211-1811

NEXT NOTES NY ダウ・ダブル・ブル・ドルヘッジETNに関する日々の開示事項

- | | |
|---|-----------------|
| 1. 上場 ETN 信託受益証券の上場受益権口数 | (令和1年6月17日 現在) |
| | 260,000 口 |
| 2. ETN の残存償還価額総額 | (令和1年6月17日 現在) |
| | 5,733,260,000 円 |
| 3. ETN の一証券あたりの償還価額 | (令和1年6月17日 現在) |
| | 22,051 円 |
| 4. ETN の一証券あたりの償還価額とダウ・ジョーンズ工業株価平均レバレッジ (2 倍)・インデックス (円ヘッジ) の 終値の変動率に係る乖離率 | (令和1年6月17日 現在) |
| | 0.00 % |

(参考) 乖離率の計算式

| | | |
|---|---|-----------|
| ETN の一証券あたりの償還価額 22,051 円 <hr style="border: 0; border-top: 1px solid black;"/> 前営業日の ETN の一証券あたり の償還価額 22,020 円 | ダウ・ジョーンズ工業株価平均レバレッジ (2 倍)・インデックス (円ヘッジ) の終値 2,198 円 <hr style="border: 0; border-top: 1px solid black;"/> 前営業日のダウ・ジョーンズ工業株価平均レバレッジ (2 倍)・インデックス (円ヘッジ) の終値 2,194 円 | × 100 (%) |
|---|---|-----------|

5. 連動対象指標と本商品の値動きに関する留意点

ダウ・ジョーンズ工業株価平均レバレッジ (2 倍)・インデックス (円ヘッジ) (以下、「対象指標」といいます。)は、日々の騰落率が、ドル/円ヘッジされたダウ・ジョーンズ工業株価平均 (プライス・リターン) (以下、「原指数」といいます。)の騰落率の2倍として計算される指数です。ただし、2 営業日以上離れた期間における対象指標の騰落率は、一般に、原指数の2倍とはならず、計算上、差 (ずれ) が不可避に生じます。

2 営業日以上離れた期間における対象指標の騰落率と原指数の騰落率の2倍との差 (ずれ) は、当該期間中の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、原指数の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差 (ずれ) が生じる可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差 (ずれ) が大きくなる傾向があります。

対象指標は円建てであり、為替レートの変動の影響を低減させるための為替ヘッジを組み込んだ指数です。ただし為替ヘッジには米ドルと円の間金利差等によるヘッジコストが生じ、そのコストが対象指標の値に反映されます。

したがって、本商品は、一般的に長期間の投資には向かず、比較的短期間の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品です。また、原指数は、配当を加味していない株価指数であり、配当を加味した株価指数に比して配当落ち分だけ減価します。

以上

各 位

発 行 者 名 ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・フ・イ
(銘柄コード: 2041)
代 表 者 名 社長兼業務執行取締役 室町 博之
問 合 せ 先 野 村 證 券 株 式 会 社
E T F ビ ジ ネ ス 企 画 室
野 村 正 明 TEL 03-3211-1811

NEXT NOTES NY ダウ・ペア・ドルヘッジETNに関する日々の開示事項

- | | |
|--|-----------------|
| 1. 上場 ETN 信託受益証券の上場受益権口数 | (令和1年6月17日 現在) |
| | 900,000 口 |
| 2. ETN の残存償還価額総額 | (令和1年6月17日 現在) |
| | 4,284,000,000 円 |
| 3. ETN の一証券あたりの償還価額 | (令和1年6月17日 現在) |
| | 4,760 円 |
| 4. ETN の一証券あたりの償還価額とダウ・ジョーンズ工業株価平均インバース (-1 倍)・インデックス (円ヘッジ) の終値の変動率に係る乖離率 | (令和1年6月17日 現在) |
| | 0.00 % |

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\begin{array}{l} \text{ETN の一証券あたりの償還価額} \\ 4,760 \text{ 円} \end{array}}{\begin{array}{l} \text{前営業日の ETN の一証券あたり} \\ \text{の償還価額} \\ 4,764 \text{ 円} \end{array}} - \frac{\begin{array}{l} \text{ダウ・ジョーンズ工業株価平均インバース (-1 倍)・インデックス} \\ \text{(円ヘッジ) の終値} \\ 294 \text{ 円} \end{array}}{\begin{array}{l} \text{前営業日のダウ・ジョーンズ工業株価平均インバース (-1 倍)・インデックス} \\ \text{(円ヘッジ) の終値} \\ 294 \text{ 円} \end{array}} \right) \times 100 (\%)$$

5. 連動対象指標と本商品の値動きに関する留意点

ダウ・ジョーンズ工業株価平均インバース (-1 倍)・インデックス (円ヘッジ) (以下、「対象指標」といいます。)は、日々の騰落率が、ドル/円ヘッジされたダウ・ジョーンズ工業株価平均 (トータル・リターン) (以下、「原指数」といいます。)の騰落率の-1 倍として計算される指数です。ただし、2 営業日以上離れた期間における対象指標の騰落率は、一般に、原指数の-1 倍とはならず、計算上、差 (ずれ) が不可避に生じます。

2 営業日以上離れた期間における対象指標の騰落率と原指数の騰落率の-1 倍との差 (ずれ) は、当該期間中の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、原指数の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差 (ずれ) が生じる可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差 (ずれ) が大きくなる傾向があります。

対象指標は円建てであり、為替レートの変動の影響を低減させるための為替ヘッジを組み込んだ指数です。ただし為替ヘッジには米ドルと円との間の金利差等によるヘッジコストが生じ、そのコストが対象指標の値に反映されます。したがって、本商品は、一般的に長期間の投資には向かず、比較的短期間の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品です。

以上

[掲載番号 12]

各 位

発 行 者 名 ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・フイー
(銘柄コード: 2042)
代 表 者 名 社長兼業務執行取締役 室町 博之
問 合 せ 先 野 村 證 券 株 式 会 社
E T F ビ ジ ネ ス 企 画 室
野 村 正 明 TEL 03-3211-1811

NEXT NOTES 東証マザーズ ETNに関する日々の開示事項

- | | |
|---|------------------|
| 1. 上場 ETN 信託受益証券の上場受益権口数 | (令和1年6月17日 現在) |
| | 1,200,000 口 |
| 2. ETN の残存償還価額総額 | (令和1年6月17日 現在) |
| | 11,880,000,000 円 |
| 3. ETN の一証券あたりの償還価額 | (令和1年6月17日 現在) |
| | 9,900 円 |
| 4. ETN の一証券あたりの償還価額と東証マザーズ指数の終値の変動率に係る乖離率 | (令和1年6月17日 現在) |
| | 0.00 % |

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[\frac{\text{ETN の一証券あたりの償還価額}}{\text{前営業日の ETN の一証券あたりの償還価額}} - \frac{\text{東証マザーズ指数の終値}}{\text{前営業日の東証マザーズ指数の終値}} \right] \times 100 (\%)$$

| | | | | |
|----------------------------|---------|--|------------------|-------|
| ETN の一証券あたりの償還価額 | 9,900 円 | | 東証マザーズ指数の終値 | 909 円 |
| 前営業日の ETN の一証券あたり の償還価額 | 9,946 円 | | 前営業日の東証マザーズ指数の終値 | 913 円 |

以上

[掲載番号 13]

各 位

発 行 者 名 ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・フイー
 (銘柄コード: 2043)
 代 表 者 名 社長兼業務執行取締役 室町 博之
 問 合 せ 先 野 村 證 券 株 式 会 社
 E T F ビ ジ ネ ス 企 画 室
 野村 正明 TEL 03-3211-1811

NEXT NOTES STOXX アセアン好配当 50 (円、ネットリターン) ETNに関する日々の開示事項

- 1. 上場 ETN 信託受益証券の上場受益権口数 (令和1年6月17日 現在)
 _____ 160,000 _____ 口
- 2. ETN の残存償還価額総額 (令和1年6月17日 現在)
 _____ 2,023,680,000 _____ 円
- 3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和1年6月17日 現在)
 _____ 12,648 _____ 円
- 4. ETN の一証券あたりの償還価額と STOXX アセアン好配当 50 (円、ネットリターン) の終値の変動率に係る乖離率
 (令和1年6月17日 現在)
 _____ 0.00 _____ %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[\frac{\begin{array}{l} \text{ETN の一証券あたりの償還価額} \\ 12,648 \text{ 円} \\ \hline \text{前営業日の ETN の一証券あたり} \\ \text{の償還価額} \quad 12,654 \text{ 円} \end{array}}{\begin{array}{l} \text{STOXX アセアン好配当 50 (円、ネットリターン) の終値} \\ 5,466 \text{ 円} \\ \hline \text{前営業日の STOXX アセアン好配当 50 (円、ネットリターン) の終値} \\ 5,468 \text{ 円} \end{array}} \right] \times 100 (\%)$$

以上

[掲載番号 15]

各 位

発 行 者 名 ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・フイー
 (銘柄コード: 2045)
 代 表 者 名 社長兼業務執行取締役 室町 博之
 問 合 せ 先 野 村 證 券 株 式 会 社
 E T F ビ ジ ネ ス 企 画 室
 野村 正明 TEL 03-3211-1811

NEXT NOTES S&P シンガポール リート(ネットリターン) ETNに関する日々の開示事項

1. 上場 ETN 信託受益証券の上場受益権口数 (令和1年6月17日 現在)
 200,000 口
2. ETN の残存償還価額総額 (令和1年6月17日 現在)
 2,545,200,000 円
3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和1年6月17日 現在)
 12,726 円
4. ETN の一証券あたりの償還価額と円換算した S&P シンガポール REIT 指数 (課税後配当込み) の終値の変動率に係る乖離率

(令和1年6月17日 現在)

※日本円の換算は、令和1年6月17日ロンドン時間午後4時頃に発表される日本円/米ドルの WM ロイター仲値とシンガポールドル/米ドルの WM ロイター仲値から算出した為替レート (1シンガポールドル=79.250円) により、計算しています。

0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{ETN の一証券あたりの償還価額}}{\text{前営業日の ETN の一証券あたりの償還価額}} - \frac{\text{円換算した S\&P シンガポール REIT 指数 (課税後配当込み) の終値}}{\text{前営業日の円換算した S\&P シンガポール REIT 指数 (課税後配当込み) の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

12,726 円 / 12,768 円 - 53,506 円 / 53,679 円

以上

各 位

発 行 者 名 ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・フイー
(銘柄コード: 2046)
代 表 者 名 社長兼業務執行取締役 室町 博之
問 合 せ 先 野 村 證 券 株 式 会 社
E T F ビ ジ ネ ス 企 画 室
野 村 正 明 TEL 03-3211-1811

NEXT NOTES インドNifty・ダブル・ブル ETNに関する日々の開示事項

1. 上場 ETN 信託受益証券の上場受益権口数 (令和1年6月17日 現在)
360,000 口
2. ETN の残存償還価額総額 (令和1年6月17日 現在)
3,816,720,000 円
3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和1年6月17日 現在)
10,602 円
4. ETN の一証券あたりの償還価額と円換算したNifty50 レバレッジ(2倍)インデックス(プライスリターン)の終値の変動率に係る乖離率
(令和1年6月17日現在)
0.00 %

※日本円の換算は、令和1年6月17日ロンドン時間午後4時頃に発表される日本円/米ドルのWMロイター仲値とインドルピー/米ドルのWMロイター仲値から算出した為替レート(1インドルピー=1.5547円)により、計算しています。

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{ETNの一証券あたりの償還価額}}{\text{前営業日のETNの一証券あたりの償還価額}} \div \frac{\text{円換算したNifty50レバレッジ(2倍)インデックス(プライスリターン)の終値}}{\text{前営業日の円換算したNifty50レバレッジ(2倍)インデックス(プライスリターン)の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

10,602 円
円換算したNifty50レバレッジ(2倍)インデックス(プライスリターン)の終値 7,864 円

10,877 円
前営業日の円換算したNifty50レバレッジ(2倍)インデックス(プライスリターン)の終値 8,068 円

5. 連動対象指標の特徴と留意点

Nifty50 レバレッジ(2倍)インデックス(プライスリターン) (以下、「対象指標」といいます。)は、日々の騰落率が、Nifty50 指数(プライス・リターン) (以下、「原指数」といいます。)の騰落率の2倍として計算される指数です。ただし、2営業日以上離れた期間における対象指標の騰落率は、一般に原指数の2倍とはならず、計算上、差(ずれ)が不可避に生じます。2営業日以上離れた期間における対象指標の騰落率と原指数の騰落率の2倍との差(ずれ)は、当該期間中の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、原指数の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差(ずれ)が生じる可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差(ずれ)が大きくなる傾向があります。

したがって、本商品は、一般的に長期間の投資には向かず、比較的短期間の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品です。また、原指数は、配当を加味していない株価指数であり、配当を加味した株価指数に比して配当落ち分だけ減価します。

以上

各 位

発 行 者 名 ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・フイー
(銘柄コード: 2047)
代 表 者 名 社長兼業務執行取締役 室町 博之
問 合 せ 先 野 村 證 券 株 式 会 社
E T F ビ ジ ネ ス 企 画 室
野 村 正 明 TEL 03-3211-1811

NEXT NOTES インドNifty・ペア ETNに関する日々の開示事項

1. 上場 ETN 信託受益証券の上場受益権口数 (令和1年6月17日 現在)
60,000 口
2. ETN の残存償還価額総額 (令和1年6月17日 現在)
400,860,000 円
3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和1年6月17日 現在)
6,681 円
4. ETN の一証券あたりの償還価額と円換算した Nifty50 デイリーインバースインデックス(トータルリターン)の終値の変動率に係る乖離率
(令和1年6月17日 現在)
 ※日本円の換算は、令和1年6月17日 ロンドン時間午後4時頃に発表される日本円/米ドルの WM ロイター仲値と
 インドルピー/米ドルの WM ロイター仲値から算出した為替レート (1 インドルピー=1.5547 円) により、計算しています。
0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{ETN の一証券あたりの償還価額}}{\text{前営業日の ETN の一証券あたりの償還価額}} - \frac{\text{円換算した Nifty50 デイリーインバースインデックス (トータルリターン) の終値}}{\text{前営業日の円換算した Nifty50 デイリーインバースインデックス (トータルリターン) の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

6,681 円
円換算した Nifty50 デイリーインバースインデックス (トータルリターン) の終値 542 円

6,588 円
前営業日の円換算した Nifty50 デイリーインバースインデックス (トータルリターン) の終値 534 円

5. 連動対象指標の特徴と留意点

Nifty50 デイリーインバースインデックス(トータルリターン) (以下、「対象指標」といいます。)は、日々の騰落率が、Nifty50 トータル・リターン指数 (以下、「原指数」といいます。)の騰落率の-1 倍として計算される指数です。ただし、2 営業日以上離れた期間における対象指標の騰落率は、一般に原指数の-1 倍とはならず、計算上、差(ずれ)が不可避に生じます。2 営業日以上離れた期間における対象指標の騰落率と原指数の騰落率の-1 倍との差(ずれ)は、当該期間中の値動きによって変化し、プラスの方向にもマイナスの方向にもどちらにも生じる可能性があります。一般に、原指数の値動きが上昇・下降を繰り返した場合に、マイナスの方向に差(ずれ)が生じる可能性が高くなります。また、一般に、期間が長くなれば長くなるほど、その差(ずれ)が大きくなる傾向があります。

したがって、本商品は、一般的に長期間の投資には向かず、比較的短期間の市況の値動きを捉えるための投資に向いている金融商品です。

以上

各 位

発 行 者 名 ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・フイー
(銘柄コード: 2048)
代 表 者 名 社長兼業務執行取締役 室町 博之
問 合 せ 先 野 村 證 券 株 式 会 社
E T F ビ ジ ネ ス 企 画 室
野 村 正 明 TEL 03-3211-1811

NEXT NOTES 野村日本株高配当 70 (ドルヘッジ、ネットリターン) ETNに関する日々の開示事項

- | | |
|---|-----------------|
| 1. 上場 ETN 信託受益証券の上場受益権口数 | (令和1年6月17日 現在) |
| | 600,000 口 |
| 2. ETN の残存償還価額総額 | (令和1年6月17日 現在) |
| | 5,644,800,000 円 |
| 3. ETN の一証券あたりの償還価額 | (令和1年6月17日現在) |
| | 9,408 円 |
| 4. ETN の一証券あたりの償還価額と円換算した野村日本株高配当 70・米ドルヘッジ指数(ネットトータルリターン)の終値の 変動率に係る乖離率 | (令和1年6月17日 現在) |
| ※日本円の換算は、令和1年6月17日ロンドン時間午後4時頃に発表される日本円/米ドルの WM ロイター仲値から算出した為替 レート (1米ドル=108.675円) により、計算しています。 | |
| | 0.00 % |

(参考) 乖離率の計算式

| | | |
|---|---|-----------|
| ETN の一証券あたりの償還価額 9,408 円 <hr style="border: 0; border-top: 1px solid black;"/> 前営業日の ETN の一証券あたり の償還価額 9,441 円 | 円換算した野村日本株高配当 70・米ドルヘッジ指数 (ネットトータルリターン) の終値 4,245,891 円 <hr style="border: 0; border-top: 1px solid black;"/> 前営業日の円換算した野村日本株高配当 70・米ドルヘッジ指数 (ネットトータルリターン) の終値 4,260,717 円 | × 100 (%) |
|---|---|-----------|

5. 連動対象指標の特徴と留意点

野村日本株高配当 70・米ドルヘッジ指数(ネットトータルリターン)(以下、「対象指標」といいます。)は、米ドルで日本の資産に投資することを想定した指数です。一般的に、外国資産への投資にあたっては、為替リスクを負いますが、対象指標は為替レート変動の影響の低減を目的として、為替ヘッジを計算上、組み込んでいます。ただし為替ヘッジには米ドルと円の間金利差等によるヘッジコストが生じ、そのコストが対象指標の値に反映されます。

ただし本商品は対象指標がドル建てでありながらも、国内上場により円で取引されるため、米ドルと円の為替レートの変動の影響を受けます。買付時点と比べて、為替レートが円高(ドル安)になった場合には、損失が生じる可能性があります。

以上

各 位

発 行 者 名 ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・フイー
(銘柄コード: 2065)
代 表 者 名 社長兼業務執行取締役 室町 博之
問 合 せ 先 野 村 證 券 株 式 会 社
E T F ビ ジ ネ ス 企 画 室
野 村 正 明 TEL 03-3211-1811

NEXT NOTES 日本株配当貴族 (ドルヘッジ、ネットリターン) ETNに関する日々の開示事項

1. 上場 ETN 信託受益証券の上場受益権口数 (令和1年6月17日 現在)
200,000 口
2. ETN の残存償還価額総額 (令和1年6月17日 現在)
2,113,800,000 円
3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和1年6月17日 現在)
10,569 円
4. ETN の一証券あたりの償還価額と円換算した S&P/JPX 配当貴族指数 (米ドルヘッジ、課税後配当込み) の終値の変動率に係る乖離率
(令和1年6月17日 現在)
0.00 %

※日本円の換算は、令和1年6月17日ロンドン時間午後4時頃に発表される日本円/米ドルの WM ロイター仲値から算出した為替レート (1米ドル=108.675円) により、計算しています。

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\begin{array}{l} \text{ETN の一証券あたりの償還価額} \\ 10,569 \text{ 円} \\ \text{前営業日の ETN の一証券あたり} \\ \text{の償還価額} \\ 10,613 \text{ 円} \end{array}}{\begin{array}{l} \text{円換算した S\&P/JPX 配当貴族指数 (米ドルヘッジ、課税後配当込み)} \\ \text{の終値} \\ 26,339 \text{ 円} \\ \text{前営業日の円換算した S\&P/JPX 配当貴族指数 (米ドルヘッジ、課税後配当込み)} \\ \text{の終値} \\ 26,445 \text{ 円} \end{array}} \right) \times 100 (\%)$$

5. 連動対象指標の特徴と留意点

S&P/JPX 配当貴族指数 (米ドルヘッジ、課税後配当込み) (以下、「対象指標」といいます。) は、米ドルで日本の資産に投資することを想定した指数です。一般的に、外国資産への投資にあたっては、為替リスクを負いますが、対象指標は為替レート変動の影響の低減を目的として、為替ヘッジを計算上、組み込んでいます。ただし為替ヘッジには米ドルと円の間金利差等によるヘッジコストが生じ、そのコストが対象指標の値に反映されます。
ただし本商品は対象指標がドル建てでありながらも、国内上場により円で取引されるため、米ドルと円の為替レートの変動の影響を受けます。買付時点と比べて、為替レートが円高 (ドル安) になった場合には、損失が生じる可能性があります。

以上

各 位

発 行 者 名 ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・フアイ
(銘柄コード: 2066)
代 表 者 名 社長兼業務執行取締役 室町 博之
問 合 せ 先 野 村 證 券 株 式 会 社
E T F ビ ジ ネ ス 企 画 室
野 村 正 明 TEL 03-3211-1811

NEXT NOTES 東証REIT (ドルヘッジ、ネットリターン) ETNに関する日々の開示事項

1. 上場 ETN 信託受益証券の上場受益権口数 (令和1年6月17日 現在)
300,000 口
2. ETN の残存償還価額総額 (令和1年6月17日 現在)
3,558,600,000 円
3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和1年6月17日現在)
11,862 円
4. ETN の一証券あたりの償還価額と円換算した税引後配当込東証 REIT 米ドルヘッジ指数の終値の変動率に係る乖離率
(令和1年6月17日 現在)
0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\begin{array}{l} \text{ETN の一証券あたりの償還価額} \\ 11,862 \text{ 円} \\ \hline \text{前営業日の ETN の一証券あたり} \\ \text{の償還価額} \quad 11,857 \text{ 円} \end{array}}{\begin{array}{l} \text{円換算した税引後配当込東証 REIT 米ドルヘッジ指数の終値} \\ 499,360 \text{ 円} \\ \hline \text{前営業日の円換算した税引後配当込東証 REIT 米ドルヘッジ指数の終値} \\ 499,127 \text{ 円} \end{array}} \right) \times 100 (\%)$$

5. 連動対象指標の特徴と留意点

税引後配当込東証 REIT 米ドルヘッジ指数 (以下、「対象指標」といいます。) は、米ドルで日本の資産に投資することを想定した指数です。一般的に、外国資産への投資にあたっては、為替リスクを負いますが、対象指標は為替レート変動の影響の低減を目的として、為替ヘッジを計算上、組み込んでいます。ただし為替ヘッジには米ドルと円の間金利差等によるヘッジコストが生じ、そのコストが対象指標の値に反映されます。

ただし本商品は対象指標がドル建てでありながらも、国内上場により円で取引されるため、米ドルと円の為替レートの変動の影響を受けます。買付時点と比べて、為替レートが円高 (ドル安) になった場合には、損失が生じる可能性があります。

以上

[掲載番号 23]

各 位

発 行 者 名 ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・フアイ
 (銘柄コード: 2069)
 代 表 者 名 社 長 兼 業 務 執 行 取 締 役 室 町 博 之
 問 合 せ 先 野 村 證 券 株 式 会 社
 E T F ビ ジ ネ ス 企 画 室
 野 村 正 明 TEL 03-3211-1811

NEXT NOTES 低ベータ 50 (ネットリターン) ETNに関する日々の開示事項

1. 上場 ETN 信託受益証券の上場受益権口数 (令和1年6月17日 現在)
 _____ 200,000 口
2. ETN の残存償還価額総額 (令和1年6月17日 現在)
 _____ 2,139,600,000 円
3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和1年6月17日現在)
 _____ 10,698 円
4. ETN の一証券あたりの償還価額と野村日本株低ベータ・セレクト 50 (配当課税考慮済指数) の終値の変動率に係る乖離率
 (令和1年6月17日 現在)
 _____ 0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[\frac{\begin{array}{l} \text{ETN の一証券あたりの償還価額} \\ 10,698 \text{ 円} \\ \hline \text{前営業日の ETN の一証券あたり} \\ \text{の償還価額} \quad 10,748 \text{ 円} \end{array}}{\begin{array}{l} \text{野村日本株低ベータ・セレクト 50 (配当課税考慮済指数) の終値} \\ 24,087 \text{ 円} \\ \hline \text{前営業日の野村日本株低ベータ・セレクト 50 (配当課税考慮済指数)} \\ \text{の終値} \quad 24,200 \text{ 円} \end{array}} \right] \times 100 (\%)$$

以上