

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 久保田 健太郎
 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 (24 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 金先物 ダブル・ブル ETN	2036	東
7	NEXT NOTES 金先物 ベア ETN	2037	東
8	NEXT NOTES ドバイ原油先物 ダブル・ブル ETN	2038	東
9	NEXT NOTES ドバイ原油先物 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 ニッチトップ中小型日本株 (ネットリターン) ETN	2050	東
20	NEXT NOTES 日本株配当貴族 (ドルヘッジ、ネットリターン) ETN	2065	東
21	NEXT NOTES 東証 REIT (ドルヘッジ、ネットリターン) ETN	2066	東
22	NEXT NOTES 野村 AI ビジネス 70 (ネットリターン) ETN	2067	東
23	NEXT NOTES 高ベータ 30 (ネットリターン) ETN	2068	東
24	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 久保田 健太郎
 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2年9月28日 現在)
 _____ 260,000 口
2. ETN の残存償還価額総額 (令和2年9月28日 現在)
 _____ 2,063,880,000 円
3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和2年9月28日 現在)
 _____ 7,938 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2年9月28日 現在)
 _____ 0.00 %

※日本円の換算は、令和2年9月28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=13.629 円) により、計算しています。

(参考) 乖離率の計算式

<table border="0" style="width: 100%;"> <tr> <td style="text-align: center;">ETN の一証券あたりの償還価額</td> <td style="text-align: center;">円換算したハンセン指数・レバレッジ</td> <td rowspan="4" style="vertical-align: middle; padding-left: 20px;">} × 100 (%)</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">7,938 円</td> <td style="text-align: center;">インデックスの終値 181,978 円</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">前営業日の ETN の一証券あたり</td> <td style="text-align: center;">前営業日の円換算したハンセン指数・レバレッジ</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">の償還価額 7,779 円</td> <td style="text-align: center;">インデックスの終値 178,315 円</td> </tr> </table>	ETN の一証券あたりの償還価額	円換算したハンセン指数・レバレッジ	} × 100 (%)	7,938 円	インデックスの終値 181,978 円	前営業日の ETN の一証券あたり	前営業日の円換算したハンセン指数・レバレッジ	の償還価額 7,779 円	インデックスの終値 178,315 円
ETN の一証券あたりの償還価額	円換算したハンセン指数・レバレッジ	} × 100 (%)							
7,938 円	インデックスの終値 181,978 円								
前営業日の ETN の一証券あたり	前営業日の円換算したハンセン指数・レバレッジ								
の償還価額 7,779 円	インデックスの終値 178,315 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 久保田 健太郎
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 香港ハンセン・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 2 年 9 月 28 日 現在) |
| | 60,000 口 |
| 2. ETN の残存償還価額総額 | (令和 2 年 9 月 28 日 現在) |
| | 387,780,000 円 |
| 3. ETN の一証券あたりの償還価額 | (令和 2 年 9 月 28 日 現在) |
| | 6,463 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 2 年 9 月 28 日 現在) |
| ※日本円の換算は、令和 2 年 9 月 28 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=13.629 円) により、計算しています。 | |
| | 0.00 % |

(参考) 乖離率の計算式

<table border="0" style="width: 100%;"> <tr> <td style="width: 50%;">ETN の一証券あたりの償還価額</td> <td style="width: 50%;">円換算したハンセン指数・ショート</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">6,463 円</td> <td style="text-align: center;">インデックスの終値 72,044 円</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">前営業日の ETN の一証券あたり</td> <td style="border-top: 1px solid black;">前営業日の円換算したハンセン指数・ショート</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">の償還価額 6,532 円</td> <td style="border-top: 1px solid black;">インデックスの終値 72,809 円</td> </tr> </table>	ETN の一証券あたりの償還価額	円換算したハンセン指数・ショート	6,463 円	インデックスの終値 72,044 円	前営業日の ETN の一証券あたり	前営業日の円換算したハンセン指数・ショート	の償還価額 6,532 円	インデックスの終値 72,809 円) × 100 (%)
ETN の一証券あたりの償還価額	円換算したハンセン指数・ショート								
6,463 円	インデックスの終値 72,044 円								
前営業日の ETN の一証券あたり	前営業日の円換算したハンセン指数・ショート								
の償還価額 6,532 円	インデックスの終値 72,809 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、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・フイー
 (銘柄コード: 2033)
 代 表 者 名 社長兼業務執行取締役 久保田 健太郎
 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2年9月28日 現在)
 60,000 口
2. ETN の残存償還価額総額 (令和2年9月28日 現在)
 590,940,000 円
3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和2年9月28日 現在)
 9,849 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2年9月28日 現在)
 0.00 %

※日本円の換算は、令和2年9月28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=0.09000 円) により、計算しています。

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\begin{array}{l} \text{ETN の一証券あたりの償還価額} \\ 9,849 \text{ 円} \end{array}}{\begin{array}{l} \text{前営業日の ETN の一証券あたり} \\ \text{の償還価額} \quad 9,642 \text{ 円} \end{array}} \times \frac{\begin{array}{l} \text{円換算した韓国総合株価指数 200 レバレッジ} \\ \text{インデックスの終値} \quad 23.68 \text{ 円} \end{array}}{\begin{array}{l} \text{前営業日の円換算した韓国総合株価指数 200 レバレッジ} \\ \text{インデックスの終値} \quad 23.18 \text{ 円} \end{array}} \right) \times 100 (\%)$$

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 久保田 健太郎
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 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2年9月28日 現在) |
| | 150,000 口 |
| 2. ETN の残存償還価額総額 | (令和2年9月28日 現在) |
| | 1,180,200,000 円 |
| 3. ETN の一証券あたりの償還価額 | (令和2年9月28日 現在) |
| | 7,868 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2年9月28日 現在) |

※日本円の換算は、令和2年9月28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=0.09000 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;">7,868 円</div> <hr style="border: 0.5px solid black;"/> 前営業日の ETN の一証券あたり の償還価額 7,989 円	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 60.84 円 <hr style="border: 0.5px solid black;"/> 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 61.77 円	$\left. \begin{array}{l} \phantom{ETN \text{ の一証券あたりの償還価額}} \\ \end{array} \right\} \times 100 (\%)$
--	--	--

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
(銘柄コード: 2035)
代 表 者 名 社長兼業務執行取締役 久保田 健太郎
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2年9月28日 現在)
14,695,000 口
2. ETN の残存償還価額総額 (令和2年9月28日 現在)
6,818,480,000 円
3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和2年9月28日 現在)
464 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2年9月28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	464 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	380 円	} × 100 (%)
前営業日の ETN の一証券あたり の償還価額	467 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	383 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

[掲載番号 7]

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: 2037)
代 表 者 名 社長兼業務執行取締役 久保田 健太郎
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 金先物 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2年9月28日 現在)
100,000 口
2. ETN の残存償還価額総額 (令和2年9月28日 現在)
570,700,000 円
3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和2年9月28日 現在)
5,707 円
4. ETN の一証券あたりの償還価額と日経・JPX 金インバース指数の終値の変動率に係る乖離率 (令和2年9月28日現在)
0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

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

5,707 円 / 5,670 円 - 4,008 円 / 3,982 円

5. 連動対象指標の特徴と留意点

日経・JPX 金インバース指数 (以下、「対象指標」といいます。) は、日々の騰落率が、日経・JPX 金指数 (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

[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 久保田 健太郎
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 ドバイ原油先物 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2年9月28日 現在)
645,000,000 口
2. ETN の残存償還価額総額 (令和2年9月28日 現在)
148,995,000,000 円
3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和2年9月28日 現在)
231 円
4. ETN の一証券あたりの償還価額と日経・JPX 原油レバレッジ指数の終値の変動率に係る乖離率 (令和2年9月28日 現在)
0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

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

231 円 / 237 円 - 329 円 / 338 円

5. 連動対象指標の特徴と留意点

日経・JPX 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・JPX 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・フイー
 (銘柄コード: 2039)
 代 表 者 名 社長兼業務執行取締役 久保田 健太郎
 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 ドバイ原油先物 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2年9月28日 現在) |
| | 700,000 口 |
| 2. ETN の残存償還価額総額 | (令和2年9月28日 現在) |
| | 4,399,500,000 円 |
| 3. ETN の一証券あたりの償還価額 | (令和2年9月28日 現在) |
| | 6,285 円 |
| 4. ETN の一証券あたりの償還価額と日経・JPX 原油インバース指数の終値の変動率に係る乖離率 | (令和2年9月28日 現在) |
| | 0.00 % |

(参考) 乖離率の計算式

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

6,285 円	3,967 円
6,203 円	3,914 円

5. 連動対象指標の特徴と留意点

日経・JPX 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・JPX 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 久保田 健太郎
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2年9月28日 現在)
1,360,000 口
2. ETN の残存償還価額総額 (令和2年9月28日 現在)
27,567,200,000 円
3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和2年9月28日 現在)
20,270 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2年9月28日 現在)
0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\begin{array}{l} \text{ETN の一証券あたりの償還価額} \\ 20,270 \text{ 円} \\ \text{前営業日の ETN の一証券あたり} \\ \text{の償還価額} \quad 19,681 \text{ 円} \end{array}}{\begin{array}{l} \text{ダウ・ジョーンズ工業株価平均レバレッジ (2 倍)・インデックス} \\ \text{(円ヘッジ) の終値} \quad 2,041 \text{ 円} \\ \text{前営業日のダウ・ジョーンズ工業株価平均レバレッジ (2 倍)・インデックス} \\ \text{(円ヘッジ) の終値} \quad 1,981 \text{ 円} \end{array}} \right) \times 100 (\%)$$

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。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・ヨーロツハ°・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 久保田 健太郎
 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・ベア・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2年9月28日 現在) |
| | 1,000,000 口 |
| 2. ETNの残存償還価額総額 | (令和2年9月28日 現在) |
| | 3,859,000,000 円 |
| 3. ETNの一証券あたりの償還価額 | (令和2年9月28日 現在) |
| | 3,859 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2年9月28日 現在) |
| | 0.00 % |

(参考) 乖離率の計算式

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

3,859 円	241 円
3,918 円	245 円

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・フアイ
(銘柄コード: 2042)
代 表 者 名 社長兼業務執行取締役 久保田 健太郎
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2年9月28日 現在) |
| | 1,200,000 口 |
| 2. ETN の残存償還価額総額 | (令和2年9月28日 現在) |
| | 15,421,200,000 円 |
| 3. ETN の一証券あたりの償還価額 | (令和2年9月28日 現在) |
| | 12,851 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2年9月28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	12,851 円		東証マザーズ指数の終値	1,187 円
前営業日の ETN の一証券あたり の償還価額	13,063 円	—	前営業日の東証マザーズ指数の終値	1,207 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 久保田 健太郎
 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2年9月28日 現在) |
| | _____ 160,000 _____ 口 |
| 2. ETN の残存償還価額総額 | (令和2年9月28日 現在) |
| | _____ 1,512,320,000 _____ 円 |
| 3. ETN の一証券あたりの償還価額 | (令和2年9月28日 現在) |
| | _____ 9,452 _____ 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2年9月28日 現在) |
| | _____ 0.00 _____ % |

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[\frac{\text{ETN の一証券あたりの償還価額}}{\text{前営業日の ETN の一証券あたりの償還価額}} - \frac{\text{STOXX アセアン好配当 50 (円、ネットリターン) の終値}}{\text{前営業日の STOXX アセアン好配当 50 (円、ネットリターン) の終値}} \right] \times 100 (\%)$$

9,452 円	4,127 円
9,406 円	4,107 円

以上

[掲載番号 14]

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: 2044)
代表者名	社長兼業務執行取締役 久保田 健太郎
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 S&P500 配当貴族(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2年9月28日 現在) | _____ 口 |
| | | 2,000,000 |
| 2. ETN の残存償還価額総額 | (令和2年9月28日 現在) | _____ 円 |
| | | 28,232,000,000 |
| 3. ETN の一証券あたりの償還価額 | (令和2年9月28日現在) | _____ 円 |
| | | 14,116 |
| 4. ETN の一証券あたりの償還価額と円換算した S&P500 配当貴族指数(課税後配当込み)の終値の変動率に係る乖離率 | (令和2年9月28日 現在) | _____ % |
- ※日本円の換算は、令和2年9月28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=105.625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 <div style="text-align: right; padding-right: 5px;">14,116 円</div>	円換算した S&P500 配当貴族指数(課税後配当込み)の終値 <div style="text-align: right; padding-right: 5px;">61,029 円</div>	$\left. \begin{array}{l} \text{---} \\ \text{---} \end{array} \right\} \times 100 (\%)$
前営業日の ETN の一証券あたり の償還価額 13,917 円	前営業日の円換算した S&P500 配当貴族指数(課税後配当込み) の終値 60,163 円	

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・フアイ (銘柄コード: 2045)
代 表 者 名	社長兼業務執行取締役 久保田 健太郎
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 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2年9月28日 現在) |
| | _____ 200,000 _____ 口 |
| 2. ETN の残存償還価額総額 | (令和2年9月28日 現在) |
| | _____ 2,447,600,000 _____ 円 |
| 3. ETN の一証券あたりの償還価額 | (令和2年9月28日 現在) |
| | _____ 12,238 _____ 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2年9月28日 現在)

※日本円の換算は、令和2年9月28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=76.874 円) により、計算しています。

_____ 0.00 _____ %

(参考) 乖離率の計算式

$\frac{\text{ETN の一証券あたりの償還価額}}{\text{前営業日の ETN の一証券あたりの償還価額}}$	=	$\frac{\text{円換算した S\&P シンガポール REIT 指数 (課税後配当込み) の終値}}{\text{前営業日の円換算した S\&P シンガポール REIT 指数 (課税後配当込み) の終値}}$) × 100 (%)
$\frac{12,238 \text{ 円}}{12,194 \text{ 円}}$		$\frac{52,088 \text{ 円}}{51,897 \text{ 円}}$	

以上

各 位

発 行 者 名 ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・フーイ
 (銘柄コード: 2046)
 代 表 者 名 社長兼業務執行取締役 久保田 健太郎
 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2年9月28日 現在)
 _____ 360,000 口
2. ETN の残存償還価額総額 (令和2年9月28日 現在)
 _____ 2,727,000,000 円
3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和2年9月28日 現在)
 _____ 7,575 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2年9月28日現在)
 ※日本円の換算は、令和2年9月28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=1.4314 円) により、計算しています。
 _____ 0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

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

7,575 円 / 7,362 円 - 5,681 円 / 5,521 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 久保田 健太郎
 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・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2年9月28日 現在)
 60,000 口
2. ETN の残存償還価額総額 (令和2年9月28日 現在)
 356,160,000 円
3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和2年9月28日 現在)
 5,936 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2年9月28日 現在)

※日本円の換算は、令和2年9月28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=1.4314 円) により、計算しています。

0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

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

5,936 円 / 6,048 円 - 486 円 / 496 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 久保田 健太郎
 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2年9月28日 現在)
 600,000 口
2. ETN の残存償還価額総額 (令和2年9月28日 現在)
 5,160,600,000 円
3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和2年9月28日現在)
 8,601 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2年9月28日 現在)
 ※日本円の換算は、令和2年9月28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=105.625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 8,601 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 3,924,624 円	} × 100 (%)
前営業日の ETN の一証券あたり の償還価額 8,450 円	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 3,855,159 円	

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。

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 19]

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: 2050)
代 表 者 名	社長兼業務執行取締役 久保田 健太郎
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 ニッチトップ中小型日本株（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2年9月28日 現在) |
| | _____ 200,000 _____ 口 |
| 2. ETN の残存償還価額総額 | (令和2年9月28日 現在) |
| | _____ 2,064,600,000 _____ 円 |
| 3. ETN の一証券あたりの償還価額 | (令和2年9月28日現在) |
| | _____ 10,323 _____ 円 |
| 4. ETN の一証券あたりの償還価額とファクトセット・グローバル・ニッチトップ・ジャパンエンタープライズ指数（課税後配当込み）の終値の変動率に係る乖離率 | (令和2年9月28日 現在) |
| | _____ 0.00 _____ % |

(参考) 乖離率の計算式

$\left[\frac{\text{ETN の一証券あたりの償還価額}}{\text{前営業日の ETN の一証券あたりの償還価額}} - \frac{\text{ファクトセット・グローバル・ニッチトップ・ジャパンエンタープライズ指数 (課税後配当込み) の終値}}{\text{前営業日のファクトセット・グローバル・ニッチトップ・ジャパンエンタープライズ指数 (課税後配当込み) の終値}} \right] \times 100 (\%)$	=	$\frac{\frac{10,323 \text{ 円}}{10,100 \text{ 円}} - \frac{1,535 \text{ 円}}{1,502 \text{ 円}}}{1} \times 100 (\%)$

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: 2065)
 代 表 者 名 社長兼業務執行取締役 久保田 健太郎
 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2年9月28日 現在)
 _____ 200,000 口
2. ETN の残存償還価額総額 (令和2年9月28日 現在)
 _____ 2,106,000,000 円
3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和2年9月28日 現在)
 _____ 10,530 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2年9月28日 現在)
 ※日本円の換算は、令和2年9月28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=105.625円) により、計算しています。
 _____ 0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\begin{array}{l} \text{ETN の一証券あたりの償還価額} \\ 10,530 \text{ 円} \\ \hline \text{前営業日の ETN の一証券あたり} \\ \text{の償還価額} \quad 10,336 \text{ 円} \end{array}}{\begin{array}{l} \text{円換算した S\&P/JPX 配当貴族指数(米ドルヘッジ、課税後配当込み)} \\ \text{の終値} \quad 26,529 \text{ 円} \\ \hline \text{前営業日の円換算した S\&P/JPX 配当貴族指数(米ドルヘッジ、課税後配当込み)} \\ \text{の終値} \quad 26,038 \text{ 円} \end{array}} \right) \times 100 (\%)$$

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 久保田 健太郎
 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2年9月28日 現在)
 300,000 口
2. ETN の残存償還価額総額 (令和2年9月28日 現在)
 3,295,800,000 円
3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和2年9月28日現在)
 10,986 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2年9月28日 現在)
 ※日本円の換算は、令和2年9月28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=105.625円) により、計算しています。
 0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left(\frac{\text{ETN の一証券あたりの償還価額}}{\text{前営業日の ETN の一証券あたりの償還価額}} - \frac{\text{円換算した税引後配当込東証 REIT 米ドルヘッジ指数の終値}}{\text{前営業日の円換算した税引後配当込東証 REIT 米ドルヘッジ指数の終値}} \right) \times 100 (\%)$$

10,986 円 / 10,911 円 - 467,546 円 / 464,332 円

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。
 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 22]

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: 2067)
代 表 者 名 社長兼業務執行取締役 久保田 健太郎
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 AI ビジネス 70 (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 2 年 9 月 28 日 現在)
600,000 口
2. ETN の残存償還価額総額 (令和 2 年 9 月 28 日 現在)
5,941,800,000 円
3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和 2 年 9 月 28 日 現在)
9,903 円
4. ETN の一証券あたりの償還価額と野村 AI ビジネス 70 (配当課税考慮済指数) の終値の変動率に係る乖離率 (令和 2 年 9 月 28 日 現在)
0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[\frac{\text{ETN の一証券あたりの償還価額}}{\text{前営業日の ETN の一証券あたりの償還価額}} - \frac{\text{野村 AI ビジネス 70 (配当課税考慮済指数) の終値}}{\text{前営業日の野村 AI ビジネス 70 (配当課税考慮済指数) の終値}} \right] \times 100 (\%)$$

9,903 円	30,466 円
9,739 円	29,959 円

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: 2068)
代 表 者 名 社長兼業務執行取締役 久保田 健太郎
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 高ベータ 30 (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2年9月28日 現在)
200,000 口
2. ETN の残存償還価額総額 (令和2年9月28日 現在)
2,017,800,000 円
3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和2年9月28日現在)
10,089 円
4. ETN の一証券あたりの償還価額と野村日本株高ベータ・セレクト 30 (配当課税考慮済指数) の終値の変動率に係る乖離率 (令和2年9月28日 現在)
0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[\frac{\begin{array}{l} \text{ETN の一証券あたりの償還価額} \\ 10,089 \text{ 円} \\ \hline \text{前営業日の ETN の一証券あたり} \\ \text{の償還価額} \quad 9,996 \text{ 円} \end{array}}{\begin{array}{l} \text{野村日本株高ベータ・セレクト 30 (配当課税考慮済指数) の終値} \\ 19,384 \text{ 円} \\ \hline \text{前営業日の野村日本株高ベータ・セレクト 30 (配当課税考慮済指数)} \\ \text{の終値} \quad 19,204 \text{ 円} \end{array}} \right] \times 100 (\%)$$

以上

[掲載番号 24]

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 久保田 健太郎
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2年9月28日 現在)
200,000 口
2. ETN の残存償還価額総額 (令和2年9月28日 現在)
2,199,000,000 円
3. ETN の一証券あたりの償還価額 (令和2年9月28日現在)
10,995 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2年9月28日 現在)
0.00 %

(参考) 乖離率の計算式

$$\left[\frac{\text{ETN の一証券あたりの償還価額}}{\text{前営業日の ETN の一証券あたりの償還価額}} - \frac{\text{野村日本株低ベータ・セレクト 50 (配当課税考慮済指数) の終値}}{\text{前営業日の野村日本株低ベータ・セレクト 50 (配当課税考慮済指数) の終値}} \right] \times 100 (\%)$$

ETN の一証券あたりの償還価額	10,995 円	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	25,028 円
前営業日の ETN の一証券あたりの償還価額	10,792 円	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) の終値	24,565 円

以上