



【2040】

NYダブルETN

NEXT NOTES NYダウ・ダブル・ブル・ドルヘッジ ETN【正式名称】

ETN



- 指数の変動率が、ダウ・ジョーンズ工業株価平均(プライス・リターン、円ヘッジ)の前日比変動率(%)の2倍となるように計算された、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・プライスリターン)との連動を目指す商品です。

1.概要

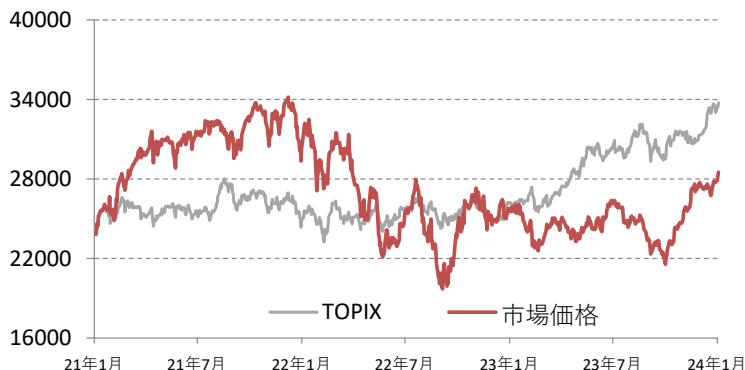
(2024年1月31日 現在)

銘柄名	NEXT NOTES NYダウ・ダブル・ブル・ドルヘッジ ETN		
対象指標	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・プライスリターン)		
計算期間	毎年5月1日～翌年4月30日		
分配金支払基準日	分配金の支払いは行われません。		
指標連動証券の発行者	ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・ブイ		
銘柄コード	2040	市場価格(終値)(※)	28,520 円
売買単位	1口単位	1売買単位あたりの投資金額(※)	28,520 円
管理費用	0.8%		

※ 上記の期日において約定がない場合、「市場価格(終値)」及び「1売買単位あたりの投資金額」には、直近時点の市場価格を記載しています。

2.パフォーマンス

(2024年1月31日 現在)



※ 2021年1月29日の市場価格を基準値とし、TOPIXの値を再換算しています。

■ 騰落率

期間	当銘柄	(参考)TOPIX
過去3か月	+29.43%	+13.20%
過去6か月	+8.75%	+9.84%
過去1年	+11.71%	+29.15%
過去3年	+19.23%	+41.04%
過去5年	+38.04%	+62.75%

3.ファンド組入銘柄

(2024年1月31日 現在)

	証券コード	銘柄名	構成比
1	-	ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・ブイ発行の外国指標連動証券(外国債券)	100.00%

4.情報ベンダーコード

情報ベンダー名	ETNコード	対象指標
QUICK	2040/T	SDJIA2LJP/USE
Bloomberg	2040 JP Equity	DJIA2LJP INDEX
Refinitiv	2040.T	.DJIA2LJP

5.対象指標の概要

日々の騰落率をダウ・ジョーンズ工業株価平均(プライス・リターン、円ヘッジ)指数の騰落率の2倍として計算された指数で、2007年12月31日の指数値を1,000ポイントとして計算されています。

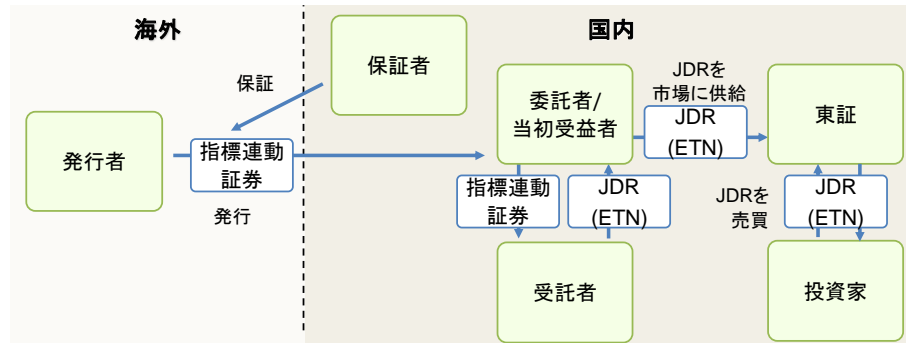
当日の指数値 = 前日の指数値 × (1 + 2倍 × ダウ・ジョーンズ工業株価平均(プライス・リターン、円ヘッジ)の前日比変動率 - 金利相当分)

【ダウ・ジョーンズ工業株価平均(プライス・リターン、円ヘッジ)指数】

米国を代表する優良企業30銘柄の株価加重指数であるダウ・ジョーンズ工業株価平均™に対して、米ドルと日本円の為替レートの変動にもなう為替リスクの回避(ヘッジ)を目指した指数です。

6. ETNとは

ETN(イー・ティー・エヌ)とは「Exchange Traded Note」の略で、「上場投資証券」または「指標連動証券」と呼ばれる上場商品です。ETNはETF(Exchange Traded Fund:上場投資信託)と同様に、価格が株価指数や商品価格等の「特定の指標」に連動する商品ですが、「Note(債券)」の単語が示すように、金融機関(発行体)がその信用力をもとに、価格が特定の指標に連動することを保証する債券であるため、ETFとは異なり証券に対する裏付資産を持たない(必要としない)という特徴があります。



※売買円滑化のためにJDR形式で上場していますが、指標連動証券と、対応するJDRの権利の内容は同一です。

※本スキーム図は概要を示したものです。詳細は有価証券届出書をご参照ください。

7. 対象指標の特徴及び留意点

- レバレッジ型指標は、変動率が原指標の日々の変動率の2倍となるように算出されているため、前営業日と比較するとその変動率は原指標の2倍となり、仮に原指標が一日で50%以上値下がりした場合は、投資金額の全額を失います。また、2営業日以上離れた期間での比較においては、複利効果により、原指標の変動率の2倍以上又は未滿となる場合があります。
- レバレッジ型指標は、原指標が上昇トレンドにある場合において、収益をさらに強く求める指標であるため、原指標の上昇を見込む場合には有用ですが、原指標が上昇・下落を相互に繰り返す場合、上記の複利効果によりレバレッジ型指標は減価していくという特性があり、このような場合、投資者は利益を得にくくなりますので留意が必要です。また、中長期にわたって投資をする場合、原指標の変動率とレバレッジ型指標の変動率の乖離が大きくなる可能性があり、留意が必要です。
- レバレッジ型指標に連動する商品は原指標が上昇(下落)を続けた場合、市場価格と理論価格が乖離し、その結果理論価格に近い価格で売ることが出来なくなる可能性がより高くなるため、留意が必要です。なお、このような市場価格と理論価格の乖離は一般的には理論価格が評価の制限値幅内の値となった際に解消されると考えられます。
- <レバレッジ型指標の詳細>
<https://www.jpx.co.jp/equities/products/etns/outline/03-01.html>
- 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、原指標は、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。

8. 情報入手一覧

- 現在値、インディカティブNAV・PCF
<http://tse.factsetdigitalsolutions.com/iopv/table?language=jp>
- 償還価額(一証券あたりの償還価額)等に関する情報
<https://www.jpx.co.jp/equities/products/etns/redemption-price/index.html>
- ETF/ETN銘柄検索
<https://money-bu-jpx.com/search/> (東証マネ部!)

9. 免責事項

- 当資料は、作成時における当商品の概要説明のみを目的としており、投資勧誘を目的としているものではなく、また金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。
- 当商品は値動きのある有価証券を投資対象としますので、連動対象である指標及び外国為替相場の変動、組入有価証券の価格の変動、組入有価証券の発行会社の倒産や財務状況等の悪化、その他の市場要因の影響等により、市場取引価格又は基準価額が値下がりし、それにより損失が生じることがあります。したがって、投資元本が保証されているものではありません。また、信用取引を利用する場合には、差し入れた保証金以上の損失が生ずるおそれがあります。
- 当商品の売買が行われる際には、あらかじめお取引先の金融商品取引業者等より交付される契約締結前交付書面等の書面の内容を十分にお読みいただき、商品の性質、取引の仕組み、リスクの存在、販売手数料、信託報酬などの手数料等を十分に御理解いただいたうえで、御自身の判断と責任で行っていただきますよう、お願い申し上げます。
- 当資料の実績数値は過去のものであり、将来の運用成果等を保証するものではありません。
- 当資料は、更新日現在の内容です。その以後、制度の改正等により、当資料に掲載した内容が予告なく変更される場合があります。また、この資料に掲載されている情報の作成には万全を期していますが、当該情報の完全性を保証するものではありません。当社は、当資料及び当資料から得た情報を利用したことにより発生するいかなる費用又は損害等の一切について責任を負いません。
- 本資料の一切の権利は当社に属しており、いかなる目的を問わず、無断複製・転載を禁じます。