



【2041】 NYダウベアETN【略称】

ETN

NEXT NOTES NYダウ・ベア・ドルヘッジ ETN【正式名称】

- 指数の変動率が、ダウ・ジョーンズ工業株価平均(トータルリターン、円ヘッジ)の前日比変動率(%)の-1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 インバース(-1倍)・インデックス(円ヘッジ・トータルリターン)を連動対象とします。JDR形式(※)での上場のため、外国証券取引口座の開設が不要となるなど、内国株式と同様にお取引いただけます。

※JDRとは有価証券(ETN)を信託財産とする受益証券です。

1. NEXT NOTES NYダウ・ベア・ドルヘッジ ETNの概要

(2018年3月30日 現在)

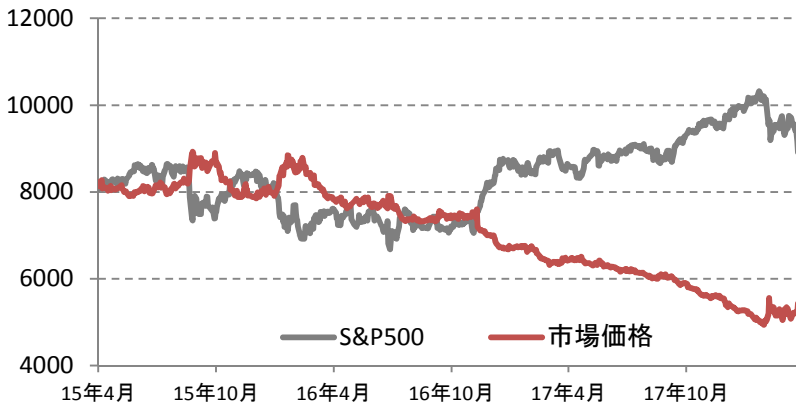
| | | | |
|------------|---|---------------------------|------------------|
| 銘柄名 | NEXT NOTES NYダウ・ベア・ドルヘッジ ETN | | |
| 対象指標 | ダウ・ジョーンズ工業株価平均 インバース(-1倍)・インデックス(円ヘッジ・トータルリターン) | | |
| 計算期間 | 毎年5月1日～翌年4月30日 | | |
| 分配金支払基準日 | 分配金の支払いは行われません。 | | |
| 指標連動証券の発行者 | ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・バイ | | |
| 銘柄コード | 2041 | 市場価格(終値)(※1) | 5,370 円 |
| 売買単位 | 1口単位 | Indicative NAV/PCFの開示(※2) | Indicative NAVのみ |
| 管理費用 | 0.8% | 1売買単位あたりの投資金額(※1) | 5,370 円 |

※1 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 Indicative NAVとは、PCF情報に現時点の株価を乗じることによって算出されるリアルタイムの推定純資産額(1口あたり)、PCFとは、管理会社よりご提供をいただいたポートフォリオ構成銘柄情報ファイルのことを指します。ここでは東証を通じて開示しているIndicative NAV/PCF情報の有無を記載しています。

2. パフォーマンス

(2018年3月30日 現在)



※ 2015年3月31日 の市場価格を基準値とし、S&P500の値を再換算しています。

■ 騰落率

| 期間 | 当銘柄 | (参考)S&P500 |
|-------|---------|------------|
| 過去3か月 | +1.70% | -6.63% |
| 過去6か月 | -8.98% | -0.95% |
| 過去1年 | -16.36% | +6.86% |
| 過去3年 | -33.95% | +13.30% |
| 過去5年 | - | +90.39% |

■ 当銘柄のボラティリティ

| | |
|----------------|-------|
| ボラティリティ(過去30日) | 26.2% |
| ボラティリティ(過去90日) | 23.1% |

※ 対象期間のうち13%以上の日に売買が成立していない場合、上場後の期間が記載の期間に満たない場合は「-」と表示されます。

対象指標の指数値 <http://www.spdji.com/>

3. ファンド組入銘柄

(2018年3月30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・バ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 | 2041/T | SDJIAIJT/USE |
| Bloomberg | 2041 JP Equity | DJIAIJT INDEX |
| Thomson Reuters | 2041.T | .DJIAIJT |

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(トータル・リターン、円ヘッジ)の騰落率の-1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 - 1倍 × ダウ・ジョーンズ工業株価平均(トータル・リターン、円ヘッジ)指数の前日比変動率 + 金利相当分)

【ダウ・ジョーンズ工業株価平均(トータル・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ともなう為替リスクの回避(ヘッジ)を目指した指数です。

6. 対象指標の特徴及び留意点

- インバース型指標は、変動率が原指標の日々の変動率の-1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-1倍となり、仮に原指標が一日で100%以上値上がりした場合は、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-1倍以上又は未満となる場合があります。
- インバース型指標は、原指標が下落トレンドにある場合において上昇する指標であるため、原指標の下落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インバース型指標は逓減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、インバース型指標は、中長期にわたって投資をする場合、原指標の変動率とインバース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。
- <インバース型指標の説明はこちら>
<https://www.jpx.co.jp/equities/products/etns/outline/03-02.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。

7. ETN情報入手一覧

- 各ETNに関するより詳細な商品概要
「野村証券 NEXT NOTES専用ホームページ」 <http://nextnotes.com/index.html>
- ETNの現在値・前日比・売買高・PCF情報・インディカティブNAV・分配金
<http://www.tse.idmanagedsolutions.com/iopv/table?language=jp&iopv=1>
- 一口あたりの純資産総額、対象指数との乖離率、ファンドの組入銘柄等
(注) 検索される場合には、検索条件に検索コード5ケタの管理会社コード「20314」を入力してください。
「適時開示情報閲覧サービス」 https://www.release.tdnet.info/inbs/I_main_00.html
- ETF株マップ
<http://etf.kabumap.com/servlets/etf/Action?SRC=page/top>

8. 免責事項

- 当資料は、作成時におけるETN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ございません。
- ETN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。
- ETNの売買を行われるに際しては、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。その後の制度改正等により、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。