

【2035】 「NEXT NOTES 日経平均VI先物指数 ETN」



- 日経平均株価に関するボラティリティ指数(日経平均ボラティリティ・インデックス)を取引対象とする先物取引(日経ボラティリティ・インデックス先物取引)の価格に基づき設計された日経平均ボラティリティ・インデックス先物指数に連動するETN(指標連動証券)です。
- JDR形式(有価証券(ETN)を信託財産とする受益証券)での上場のため、内国株式と同様にお取引いただけます。(外国証券取引口座の開設は不要です。)

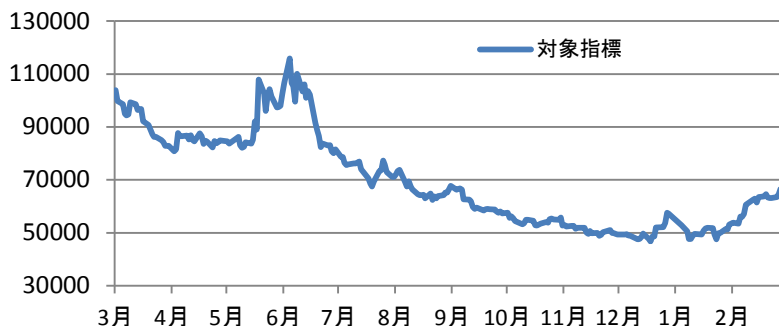
1. NEXT NOTES 日経平均VI先物指数 ETNの概要

銘柄名	NEXT NOTES 日経平均VI先物指数 ETN		
銘柄コード	2035		
対象指標	日経平均VI先物指数		
信託の計算期日	毎年4月30日		
指標連動証券の保証者	野村ホールディングス株式会社(銘柄コード: 8604)		
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(※1)		
信託委託者	野村證券株式会社		
信託受託者	三菱UFJ信託銀行株式会社、日本マスタートラスト信託銀行株式会社		
上場取引所	東京証券取引所	貸借銘柄選定	なし
売買単位	1口単位	iNAV/PCFの配信	準備中
分配金支払基準日	分配金の支払いは行われません。	上場日	2013年4月19日
管理費用(※2)	0.95%(年率)	指標連動証券償還日	2033年2月7日

※1 野村ホールディングス株式会社の100%子会社(オランダ籍)です。

※2 投資信託の信託報酬に相当する手数料であり、指標のパフォーマンスから控除されます。

2. 対象指標の推移 (平成24年3月1日 ~ 平成25年2月28日)



■ 対象指標の騰落率

期間	対象指標
過去3ヶ月	+35.50%
過去6ヶ月	+0.80%
過去1年	-35.70%

3. 対象指標の概要

【日経平均ボラティリティ・インデックス先物指数】

大阪証券取引所の日経平均ボラティリティ・インデックス先物取引(日経平均VI先物取引)を対象とし、期近限月と期先限月のウエートを日々調整することで、仮想的に満期1ヶ月の日経平均VI先物取引を合成し、その合成した先物取引の価格の日々の変動率に連動するよう設計された指数です。2012年2月27日の値を100,000としています。

※組成された満期1ヶ月の日経平均VI先物取引は仮想的なものであり、後述の日経平均VI先物取引と異なり大阪証券取引所の上場商品ではありません。

【日経平均ボラティリティ・インデックス先物取引】

日経平均ボラティリティ・インデックスを取引の対象とする、大阪証券取引所に上場する先物取引です。

【日経平均ボラティリティ・インデックス】

投資家が日経平均株価の将来の変動をどのように想定しているかを表した指数であり、現在の市場で見込まれている日経平均株価(日経平均)の1ヶ月先の変動率を示します。指数値が高いほど、投資家が今後、相場が大きく変動すると見込んでいることを意味します。

4. ETNとは？

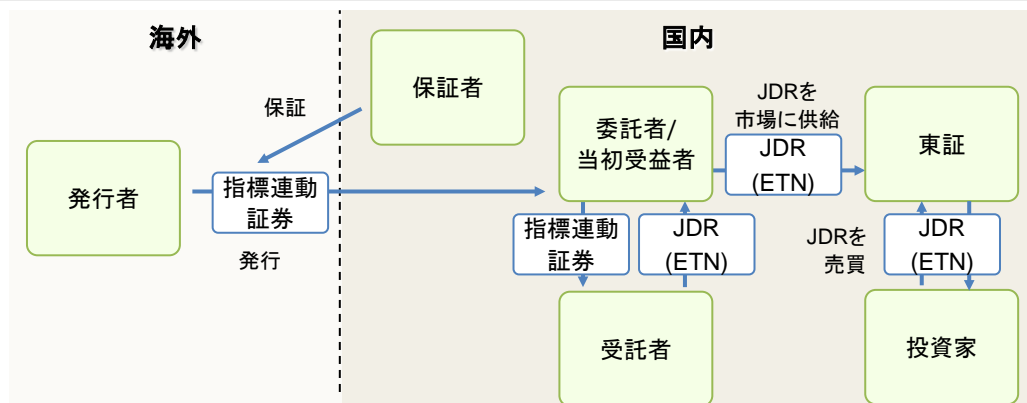
ETNとは「Exchange Traded Note」の略で、「上場投資証券」または「指標連動証券」と呼ばれる上場商品です。ETF(Exchange Traded Fund: 上場投資信託)と同様に、価格が株価指数や商品価格等の「特定の指標」に連動し、小額で購入可能、一般的に低コスト、株式と同じようにリアルタイム売買が可能という特徴を持っています。

また、「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)という点も特徴の一つです。

<ETNの詳しい説明はこちら>

<http://www.tse.or.jp/rules/etf/etninfo/index.html>

5. スキーム図



※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。

6. ETN情報入手一覧

- 当ETNに関するより詳細な商品概要
「野村證券 NEXT NOTES専用ホームページ」<http://nextnotes.com/>
- 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「20314」を入力してください。
「適時開示情報閲覧サービス」<http://www.tse.or.jp/listing/disclosure/>
- 週次レポート(市場価格の推移・騰落率・投資パフォーマンス・分配金推移など)
<http://www.tse.or.jp/rules/etf/list-etn/index.html>
- ETNの現在値・前日比・売買高
<http://www.tse.idmanagedsolutions.com/iopv/table?language=jp&iopv=0>
- 情報ベンダーコード

情報ベンダー名	QUICK	Bloomberg	ロイター
ETNコード	2035/T	2035 JT Equity	2035.T
対象指数	S101#VIF/NKNJ	NKYVF	.N225VF

- 対象指標の算出要領等
<http://indexes.nikkei.co.jp/nkave/index/profile?idx=nk225vifi>

7. 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。
- 当資料は、2013年3月現在の内容です。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。

<お問い合わせ>

株式会社東京証券取引所 上場推進部 〒103-8220 東京都中央区日本橋兜町2-1 Tel:03-3666-0141(代)