

各位

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

2020年4月期(2019年5月1日～2020年4月30日)信託財産状況報告書

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下記のETN銘柄について、信託財産状況報告書(以下、「本報告書」といいます)を開示(※注)致します。

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 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

※注

本報告書は、信託業法第27条第1項の規定に基づき、受託者たる三菱UFJ信託銀行株式会社が作成し、東京証券取引所の有価証券上場規程に定める上場外国指標連動証券信託受益証券の発行者たるノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・ブイが開示致します。

NEXT NOTES ニッチトップ中小型日本株(ネットリターン)ETN信託財産状況報告書の2020年4月期は、2019年7月10日～2020年4月30日です。

以上

NEXT NOTES 香港ハンセン・ダブル・ブル ETN 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ
第 8 期	平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。
2020 年 4 月 30 日現在	受益証券発行信託「NEXT NOTES 香港ハンセン・ダブル・ブル ETN」の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。
2019 年 5 月 1 日～2020 年 4 月 30 日	今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES 香港ハンセン・ダブル・ブル ETN
銘柄コード	2031
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	野村證券株式会社
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
信託財産	本信託財産は、ハンセン指数・レバレッジインデックス（以下、「本指標」といいます。）に連動する債券（以下、「受託有価証券」といいます。）およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとします。また、受託者は、受託有価証券をカストディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。
信託財産の運用	受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。
収益分配方法	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

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）

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	ハンセン指数・レバレッジインデックス連動債
数量	260,000 口（2020 年 4 月 30 日時点）
価格	2,363,920,000 円（2020 年 4 月 30 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	9,092 円（2020 年 4 月 30 日時点）（注 3）
保管機関	受託者の指定するカストディアン

注 1：外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 2：計算期間末日（2020 年 4 月 30 日）時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注 3：外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円 (2020年4月30日現在)

注1：上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
2,363,920,000円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況 (自2019年5月1日至2020年4月30日)

1. 信託の設定、解約

(千円未満切捨て)

設定		解約	
口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)	口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)
—	—	—	—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

3. 信託業務の委託の状況

信託業務 (信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。) の第三者への委託は行っておりません。
 カストディー業務については、ルクセンブルグ三菱UFJインベスターサービス銀行 S.A. に委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末 (2020年4月30日) 現在
 (単位：千円)

資産の部		
固定資産		
投資有価証券		2,363,920
固定資産合計		2,363,920
資産合計		2,363,920
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		3,203,900
元本合計		3,203,900
留保金		
留保金合計		—
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		△839,980
評価・換算差額等合計		△839,980
元本等合計		2,363,920
負債・元本等合計		2,363,920

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分額	—
次期繰越利益	—

注1：本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

注2：当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■収益の分配の状況について

分配金はありません。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額（単位：円）
2019年5月31日	11,631
2019年6月28日	12,981
2019年7月31日	12,319
2019年8月31日	10,267
2019年9月30日	10,704
2019年10月31日	11,351
2019年11月29日	10,980
2019年12月30日	12,639
2020年1月31日	10,811
2020年2月28日	10,524
2020年3月31日	8,465
2020年4月30日	9,092

NEXT NOTES 香港ハンセン・ベア ETN 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ
第 8 期	平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「NEXT NOTES 香港ハンセン・ベア ETN」 の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
2020 年 4 月 30 日現在	
2019 年 5 月 1 日～2020 年 4 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES 香港ハンセン・ベア ETN
銘柄コード	2032
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	野村証券株式会社
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
信託財産	本信託財産は、ハンセン指数・ショートインデックス（以下、「本指標」といいます。）に連動する債券（以下、「受託有価証券」といいます。）およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとします。また、受託者は、受託有価証券をカスタディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。
信託財産の運用	受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。
収益分配方法	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

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）

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	ハンセン指数・ショートインデックス連動債
数量	60,000 口（2020 年 4 月 30 日時点）
価格	394,440,000 円（2020 年 4 月 30 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	6,574 円（2020 年 4 月 30 日時点）（注 3）
保管機関	受託者の指定するカスタディアン

注 1：外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 2：計算期間末日（2020 年 4 月 30 日）時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注 3：外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円 (2020年4月30日現在)

注1：上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
394,440,000円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況 (自2019年5月1日至2020年4月30日)

1. 信託の設定、解約 (千円未満切捨て)

設定		解約	
口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)	口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)
—	—	—	—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

3. 信託業務の委託の状況

信託業務 (信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。) の第三者への委託は行っておりません。
 カストディー業務については、ルクセンブルグ三菱UFJインベスターサービス銀行 S. A. に委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末 (2020年4月30日) 現在
 (単位：千円)

資産の部		
固定資産		
投資有価証券		394,440
固定資産合計		394,440
資産合計		394,440
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		600,000
元本合計		600,000
留保金		
留保金合計		—
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		△205,560
評価・換算差額等合計		△205,560
元本等合計		394,440
負債・元本等合計		394,440

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分額	—
次期繰越利益	—

注1：本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

注2：当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■収益の分配の状況について

分配金はありません。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額（単位：円）
2019年5月31日	6,357
2019年6月28日	5,931
2019年7月31日	6,110
2019年8月31日	6,404
2019年9月30日	6,382
2019年10月31日	6,183
2019年11月29日	6,388
2019年12月30日	5,948
2020年1月31日	6,376
2020年2月28日	6,338
2020年3月31日	6,927
2020年4月30日	6,574

NEXT NOTES 韓国 KOSPI・ダブル・ブル ETN 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ
第 8 期	平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「NEXT NOTES 韓国 KOSPI・ダブル・ブル ETN」の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
2020 年 4 月 30 日現在	
2019 年 5 月 1 日～2020 年 4 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES 韓国 KOSPI・ダブル・ブル ETN
銘柄コード	2033
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	野村証券株式会社
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
信託財産	<p>本信託財産は、韓国総合株価指数 200・レバレッジインデックス（以下、「本指標」といいます。）に連動する債券（以下、「受託有価証券」といいます。）およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとします。また、受託者は、受託有価証券をカストディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。</p>
信託財産の運用	<p>受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。</p>
収益分配方法	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

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）

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	韓国総合株価指数 200・レバレッジインデックス連動債
数量	60,000 口（2020 年 4 月 30 日時点）
価格	418,920,000 円（2020 年 4 月 30 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	6,982 円（2020 年 4 月 30 日時点）（注 3）
保管機関	受託者の指定するカストディアン

注 1：外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 2：計算期間末日（2020 年 4 月 30 日）時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注 3：外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円 (2020年4月30日現在)

注1：上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
418,920,000円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況 (自2019年5月1日至2020年4月30日)

1. 信託の設定、解約 (千円未満切捨て)

設定		解約	
口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)	口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)
—	—	—	—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

3. 信託業務の委託の状況

信託業務 (信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。) の第三者への委託は行っておりません。
 カストディー業務については、ルクセンブルグ三菱UFJインベスターサービス銀行 S.A. に委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末 (2020年4月30日) 現在
 (単位：千円)

資産の部	
固定資産	
投資有価証券	418,920
固定資産合計	418,920
資産合計	418,920
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	600,000
元本合計	600,000
留保金	
留保金合計	—
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△181,080
評価・換算差額等合計	△181,080
元本等合計	418,920
負債・元本等合計	418,920

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分額	—
次期繰越利益	—

注1：本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

注2：当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■収益の分配の状況について

分配金はありません。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額（単位：円）
2019年5月31日	8,239
2019年6月28日	9,299
2019年7月31日	8,392
2019年8月31日	7,548
2019年9月30日	8,656
2019年10月31日	9,019
2019年11月29日	9,031
2019年12月30日	10,309
2020年1月31日	9,284
2020年2月28日	7,988
2020年3月31日	5,990
2020年4月30日	6,982

NEXT NOTES 韓国 KOSPI・ベア ETN 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ
第 8 期	平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「NEXT NOTES 韓国 KOSPI・ベア ETN」の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
2020 年 4 月 30 日現在	
2019 年 5 月 1 日～2020 年 4 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES 韓国 KOSPI・ベア ETN
銘柄コード	2034
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	野村證券株式会社
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
信託財産	<p>本信託財産は、韓国総合株価指数 200 (先物)・インバースインデックス (以下、「本指標」といいます。) に連動する債券 (以下、「受託有価証券」といいます。) およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとします。また、受託者は、受託有価証券をカスタディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。</p>
信託財産の運用	<p>受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。</p>
収益分配方法	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

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)

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	韓国総合株価指数 200 (先物)・インバースインデックス連動債
数量	150,000 口 (2020 年 4 月 30 日時点)
価格	1,411,350,000 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	9,409 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 3)
保管機関	受託者の指定するカスタディアン

注 1 : 外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 2 : 計算期間末日 (2020 年 4 月 30 日) 時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注 3 : 外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円 (2020年4月30日現在)

注1：上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
1,411,350,000円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況 (自2019年5月1日至2020年4月30日)

1. 信託の設定、解約

(千円未満切捨て)

設定		解約	
口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)	口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)
—	—	—	—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

3. 信託業務の委託の状況

信託業務（信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。）の第三者への委託は行っておりません。
 カストディー業務については、ルクセンブルグ三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.に委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末 (2020年4月30日) 現在
 (単位：千円)

資産の部		
固定資産		
投資有価証券		1,411,350
固定資産合計		1,411,350
資産合計		1,411,350
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		1,564,530
元本合計		1,564,530
留保金		
留保金合計		—
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		△153,180
評価・換算差額等合計		△153,180
元本等合計		1,411,350
負債・元本等合計		1,411,350

<損益計算書（注1）（注2）>

当計算期間（自 2019年5月1日 至 2020年4月30日）

（単位：千円）

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分量	—
次期繰越利益	—

注1：本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

注2：当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■収益の分配の状況について

分配金はありません。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額（単位：円）
2019年5月31日	10,387
2019年6月28日	10,063
2019年7月31日	10,314
2019年8月30日	10,125
2019年9月30日	9,868
2019年10月31日	10,052
2019年11月29日	9,980
2019年12月30日	9,438
2020年1月31日	9,401
2020年2月28日	9,722
2020年3月31日	10,489
2020年4月30日	9,409

NEXT NOTES 日経平均 VI 先物指数 ETN 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ 平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「NEXT NOTES 日経平均 VI 先物指数 ETN」 の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
第 8 期	
2020 年 4 月 30 日現在	
2019 年 5 月 1 日～2020 年 4 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES 日経平均 VI 先物指数 ETN
銘柄コード	2035
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	野村證券株式会社
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
信託財産	本信託財産は、日経平均 VI 先物指数（以下、「本指標」といいます。）に連動する債券（以下、「受託有価証券」といいます。）およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとし、また、受託者は、受託有価証券をカスタディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。
信託財産の運用	受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。
収益分配方法	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

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）

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	日経平均 VI 先物指数連動債 2（注 1）
数量	14,695,000 口（2020 年 4 月 30 日時点）
価格	14,768,475,000 円（2020 年 4 月 30 日時点）（注 2）（注 3）
一口あたりの価格	1,005 円（2020 年 4 月 30 日時点）（注 4）
保管機関	受託者の指定するカスタディアン

注 1：2019 年 9 月 5 日を以って、信託財産を構成する資産は「日経平均 V I 先物指数連動債」から「日経平均 V I 先物指数連動債 2」に交換されています。

注 2：外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 3：計算期間末日（2020 年 4 月 30 日）時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注 4：外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円 (2020年4月30日現在)

注1：上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
14,768,475,000円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況 (自2019年5月1日至2020年4月30日)

1. 信託の設定、解約

(千円未満切捨て)

設定		解約	
口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)	口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)
13,300,000	23,083,100	—	—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

3. 信託業務の委託の状況

信託業務 (信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。) の第三者への委託は行っておりません。
 カストディー業務については、ルクセンブルグ三菱UFJインベスターサービス銀行 S.A. に委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末 (2020年4月30日) 現在
 (単位：千円)

資産の部	
固定資産	
投資有価証券	14,768,475
固定資産合計	14,768,475
資産合計	14,768,475
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	25,481,540
元本合計	25,481,540
留保金	
次期繰越損失 (△)	△6,833,004
留保金合計	△6,833,004
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△3,880,061
評価・換算差額等合計	△3,880,061
元本等合計	14,768,475
負債・元本等合計	14,768,475

<損益計算書（注1）（注2）>

当計算期間（自 2019年5月1日 至 2020年4月30日）

（単位：千円）

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越損失（△）	△6,833,004
当期末処理損失（△）	△6,833,004
次期繰越損失（△）	△6,833,004

注1：本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

注2：当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■収益の分配の状況について

分配金はありません。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額（単位：円）
2019年5月31日	1,084
2019年6月28日	866
2019年7月31日	774
2019年8月30日	850
2019年9月30日	746
2019年10月31日	610
2019年11月29日	562
2019年12月30日	498
2020年1月31日	527
2020年2月28日	810
2020年3月31日	1,796
2020年4月30日	1,005

NEXT NOTES 日経・TOCOM 金ダブル・ブル ETN 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ
第 8 期	平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「NEXT NOTES 日経・TOCOM 金ダブル・ブル ETN」の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
2020 年 4 月 30 日現在	
2019 年 5 月 1 日～2020 年 4 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES 日経・TOCOM 金ダブル・ブル ETN
銘柄コード	2036
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	野村證券株式会社
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
信託財産	<p>本信託財産は、日経・東商取金レバレッジ指数（以下、「本指標」といいます。）に連動する債券（以下、「受託有価証券」といいます。）およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとし、また、受託者は、受託有価証券をカストディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。</p>
信託財産の運用	<p>受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。</p>
収益分配方法	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

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）

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	日経・東商取金レバレッジ指数連動債
数量	250,000 口（2020 年 4 月 30 日時点）
価格	3,932,500,000 円（2020 年 4 月 30 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	15,730 円（2020 年 4 月 30 日時点）（注 3）
保管機関	受託者の指定するカストディアン

注 1：外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 2：計算期間末日（2020 年 4 月 30 日）時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注 3：外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円 (2020年4月30日現在)

注1：上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
3,932,500,000円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況 (自2019年5月1日至2020年4月30日)

1. 信託の設定、解約

(千円未満切捨て)

設定		解約	
口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)	口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)
—	—	—	—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

3. 信託業務の委託の状況

信託業務（信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。）の第三者への委託は行っておりません。
 カストディー業務については、ルクセンブルグ三菱UFJインベスターサービス銀行S.A.に委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末 (2020年4月30日) 現在
 (単位：千円)

資産の部		
固定資産		
投資有価証券		3,932,500
固定資産合計		3,932,500
資産合計		3,932,500
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		2,262,560
元本合計		2,262,560
留保金		
留保金合計		—
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		1,669,940
評価・換算差額等合計		1,669,940
元本等合計		3,932,500
負債・元本等合計		3,932,500

<損益計算書（注1）（注2）>

当計算期間（自 2019年5月1日 至 2020年4月30日）

（単位：千円）

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分量	—
次期繰越利益	—

注1：本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

注2：当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■収益の分配の状況について

分配金はありません。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額（単位：円）
2019年5月31日	9,614
2019年6月28日	11,235
2019年7月31日	11,636
2019年8月30日	12,763
2019年9月30日	12,460
2019年10月31日	12,742
2019年11月29日	12,282
2019年12月30日	13,161
2020年1月31日	14,145
2020年2月28日	15,013
2020年3月31日	14,331
2020年4月30日	15,730

NEXT NOTES 日経・TOCOM 金ベア ETN 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ
第 8 期	平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「NEXT NOTES 日経・TOCOM 金ベア ETN」 の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
2020 年 4 月 30 日現在	
2019 年 5 月 1 日～2020 年 4 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES 日経・TOCOM 金ベア ETN
銘柄コード	2037
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	野村證券株式会社
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
信託財産	<p>本信託財産は、日経・東商取金インバース指数（以下、「本指標」といいます。）に連動する債券（以下、「受託有価証券」といいます。）およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとし、また、受託者は、受託有価証券をカストディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。</p>
信託財産の運用	<p>受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。</p>
収益分配方法	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

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）

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	日経・東商取金インバース指数連動債
数量	100,000 口（2020 年 4 月 30 日時点）
価格	621,000,000 円（2020 年 4 月 30 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	6,210 円（2020 年 4 月 30 日時点）（注 3）
保管機関	受託者の指定するカストディアン

注 1：外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 2：計算期間末日（2020 年 4 月 30 日）時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注 3：外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円 (2020年4月30日現在)

注1：上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
621,000,000円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況 (自2019年5月1日至2020年4月30日)

1. 信託の設定、解約 (千円未満切捨て)

設定		解約	
口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)	口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)
40,000	251,240	—	—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

3. 信託業務の委託の状況

信託業務 (信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。) の第三者への委託は行っておりません。
 カストディー業務については、ルクセンブルグ三菱UFJインバスターサービス銀行 S.A. に委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末 (2020年4月30日) 現在
 (単位：千円)

資産の部	
固定資産	
投資有価証券	621,000
固定資産合計	621,000
資産合計	621,000
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	851,240
元本合計	851,240
留保金	
留保金合計	—
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△230,240
評価・換算差額等合計	△230,240
元本等合計	621,000
負債・元本等合計	621,000

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分額	—
次期繰越利益	—

注1：本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

注2：当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■収益の分配の状況について

分配金はありません。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額（単位：円）
2019年5月31日	8,332
2019年6月28日	7,689
2019年7月31日	7,533
2019年8月30日	7,174
2019年9月30日	7,244
2019年10月31日	7,147
2019年11月29日	7,268
2019年12月30日	7,010
2020年1月31日	6,736
2020年2月28日	6,517
2020年3月31日	6,552
2020年4月30日	6,210

NEXT NOTES 日経・TOCOM 原油ダブル・ブル ETN 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ
第 8 期	平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「NEXT NOTES 日経・TOCOM 原油ダブル・ブル ETN」の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
2020 年 4 月 30 日現在	
2019 年 5 月 1 日～2020 年 4 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES 日経・TOCOM 原油ダブル・ブル ETN
銘柄コード	2038
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	野村証券株式会社
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
信託財産	本信託財産は、日経・東商取原油レバレッジ指数（以下、「本指標」といいます。）に連動する債券（以下、「受託有価証券」といいます。）およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとし、また、受託者は、受託有価証券をカストディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。
信託財産の運用	受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価格は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。
収益分配方法	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

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）

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	日経・東商取原油レバレッジ指数連動債 2（注 1）
数量	445,000,000 口（2020 年 4 月 30 日時点）
価格	68,975,000,000 円（2020 年 4 月 30 日時点）（注 2）（注 3）
一口あたりの価格	155 円（2020 年 4 月 30 日時点）（注 4）
保管機関	受託者の指定するカストディアン

注 1：2016 年 3 月 17 日を以って、信託財産を構成する資産は「日経・東商取原油レバレッジ指数連動債」から「日経・東商取原油レバレッジ指数連動債 2」に交換されています。

注 2：外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 3：計算期間末日（2020 年 4 月 30 日）時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注 4：外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円 (2020年4月30日現在)

注1：上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
68,975,000,000円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況 (自2019年5月1日至2020年4月30日)

1. 信託の設定、解約 (千円未満切捨て)

設定		解約	
口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)	口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)
425,000,000	139,650,000		—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

3. 信託業務の委託の状況

信託業務 (信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。) の第三者への委託は行っておりません。
 カストディー業務については、ルクセンブルグ三菱UFJインバスターサービス銀行 S.A. に委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末 (2020年4月30日) 現在
 (単位：千円)

資産の部	
固定資産	
投資有価証券	68,975,000
固定資産合計	68,975,000
資産合計	68,975,000
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	168,286,864
元本合計	168,286,864
留保金	
次期繰越損失 (△)	△99,311,864
留保金合計	△99,311,864
評価・換算差額等	
評価・換算差額等合計	—
元本等合計	68,975,000
負債・元本等合計	68,975,000

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
特別利益	—
特別損失	—
投資有価証券評価損	99,311,864
当期純損失（△）	△99,311,864
前期繰越損失（△）	—
当期未処利損失（△）	△99,311,864
次期繰越損失（△）	△99,311,864

注1：本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

■信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■収益の分配の状況について

分配金はありません。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額（単位：円）
2019年5月31日	1,351
2019年6月28日	1,379
2019年7月31日	1,363
2019年8月30日	1,120
2019年9月30日	1,136
2019年10月31日	1,162
2019年11月29日	1,339
2019年12月30日	1,542
2020年1月31日	1,215
2020年2月28日	941
2020年3月31日	335
2020年4月30日	155

NEXT NOTES 日経・TOCOM 原油 ベア ETN 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ
第 8 期	平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「NEXT NOTES 日経・TOCOM 原油 ベア ETN」の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
2020 年 4 月 30 日現在	
2019 年 5 月 1 日～2020 年 4 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES 日経・TOCOM 原油 ベア ETN
銘柄コード	2039
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	野村證券株式会社
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
信託財産	<p>本信託財産は、日経・東商取原油インバース指数（以下、「本指標」といいます。）に連動する債券（以下、「受託有価証券」といいます。）およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとし、また、受託者は、受託有価証券をカストディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。</p>
信託財産の運用	<p>受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。</p>
収益分配方法	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

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）

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	日経・東商取原油インバース指数連動債
数量	700,000 口（2020 年 4 月 30 日時点）
価格	6,102,600,000 円（2020 年 4 月 30 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	8,718 円（2020 年 4 月 30 日時点）（注 3）
保管機関	受託者の指定するカストディアン

注 1：外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 2：計算期間末日（2020 年 4 月 30 日）時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注 3：外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円 (2020年4月30日現在)

注1：上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
6,102,600,000円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況 (自2019年5月1日至2020年4月30日)

1. 信託の設定、解約 (千円未満切捨て)

設定		解約	
口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)	口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)
—	—	—	—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

3. 信託業務の委託の状況

信託業務(信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。)の第三者への委託は行っておりません。カスタディー業務については、ルクセンブルグ三菱UFJインバスターサービス銀行S.A.に委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末 (2020年4月30日) 現在
(単位：千円)

資産の部	
固定資産	
投資有価証券	6,102,600
固定資産合計	6,102,600
資産合計	6,102,600
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	8,022,400
元本合計	8,022,400
留保金	
留保金合計	—
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△1,919,800
評価・換算差額等合計	△1,919,800
元本等合計	6,102,600
負債・元本等合計	6,102,600

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分額	—
次期繰越利益	—

注1：本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

注2：当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■収益の分配の状況について

分配金はありません。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額（単位：円）
2019年5月31日	7,612
2019年6月28日	7,414
2019年7月31日	7,362
2019年8月30日	7,965
2019年9月30日	7,648
2019年10月31日	7,493
2019年11月29日	6,901
2019年12月30日	6,399
2020年1月31日	7,105
2020年2月28日	7,930
2020年3月31日	8,948
2020年4月30日	8,718

NEXT NOTES NY ダウ・ダブル・ブル・ドルヘッジ ETN 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ 平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「NEXT NOTES NY ダウ・ダブル・ブル・ドルヘッジ ETN」の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
第 7 期	
2020 年 4 月 30 日現在	
2019 年 5 月 1 日～2020 年 4 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES NY ダウ・ダブル・ブル・ドルヘッジ ETN
銘柄コード	2040
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	野村證券株式会社
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
信託財産	本信託財産は、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) (以下、「本指標」といいます。) に連動する債券 (以下、「受託有価証券」といいます。) およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとします。また、受託者は、受託有価証券をカストディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。
信託財産の運用	受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。
収益分配方法	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

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)

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	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)連動債
数量	1,360,000 口 (2020 年 4 月 30 日時点)
価格	22,117,680,000 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	16,263 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 3)
保管機関	受託者の指定するカストディアン

注 1：外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 2：計算期間末日 (2020 年 4 月 30 日) 時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注 3：外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円 (2020年4月30日現在)

注1：上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
22,117,680,000円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況 (自2019年5月1日至2020年4月30日)

1. 信託の設定、解約 (千円未満切捨て)

設定		解約	
口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)	口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)
1,100,000	15,566,500	—	—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

3. 信託業務の委託の状況

信託業務 (信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。) の第三者への委託は行っておりません。
 カストディー業務については、ルクセンブルグ三菱UFJインベスターサービス銀行 S.A. に委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末 (2020年4月30日) 現在
 (単位：千円)

資産の部	
固定資産	
投資有価証券	22,117,680
固定資産合計	22,117,680
資産合計	22,117,680
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	18,474,800
元本合計	18,474,800
留保金	
留保金合計	—
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	3,642,880
評価・換算差額等合計	3,642,880
元本等合計	22,117,680
負債・元本等合計	22,117,680

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分額	—
次期繰越利益	—

注1: 本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

注2: 当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■ 信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■ 収益の分配の状況について

分配金はありません。

■ 信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額 (単位: 円)
2019年5月31日	19,991
2019年6月28日	22,804
2019年7月31日	23,127
2019年8月30日	22,166
2019年9月30日	22,927
2019年10月31日	23,002
2019年11月29日	24,663
2019年12月30日	25,218
2020年1月31日	24,717
2020年2月28日	19,818
2020年3月31日	13,436
2020年4月30日	16,263

NEXT NOTES NY ダウ・ベア・ドルヘッジ ETN 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ
第 7 期	平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「NEXT NOTES NY ダウ・ベア・ドルヘッジ ETN」の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
2020 年 4 月 30 日現在	
2019 年 5 月 1 日～2020 年 4 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES NY ダウ・ベア・ドルヘッジ ETN
銘柄コード	2041
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	野村證券株式会社
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
信託財産	<p>本信託財産は、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) (以下、「本指標」といいます。) に連動する債券 (以下、「受託有価証券」といいます。) およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとし、また、受託者は、受託有価証券をカストディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。</p>
信託財産の運用	<p>受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。</p>
収益分配方法	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

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)

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	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)連動債
数量	1,000,000 口 (2020 年 4 月 30 日時点)
価格	4,526,000,000 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	4,526 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 3)
保管機関	受託者の指定するカストディアン

注 1 : 外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 2 : 計算期間末日 (2020 年 4 月 30 日) 時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注 3 : 外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円 (2020年4月30日現在)

注1：上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
4,526,000,000円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況 (自2019年5月1日至2020年4月30日)

1. 信託の設定、解約 (千円未満切捨て)

設定		解約	
口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)	口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)
100,000	456,000	—	—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

3. 信託業務の委託の状況

信託業務 (信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。) の第三者への委託は行っておりません。
 カストディー業務については、ルクセンブルグ三菱UFJインベスターサービス銀行 S.A. に委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末 (2020年4月30日) 現在
 (単位：千円)

資産の部	
固定資産	
投資有価証券	4,526,000
固定資産合計	4,526,000
資産合計	4,526,000
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	7,440,340
元本合計	7,440,340
留保金	
留保金合計	—
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△2,914,340
評価・換算差額等合計	△2,914,340
元本等合計	4,526,000
負債・元本等合計	4,526,000

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分額	—
次期繰越利益	—

注1：本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

注2：当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■収益の分配の状況について

分配金はありません。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額（単位：円）
2019年5月31日	5,013
2019年6月28日	4,677
2019年7月31日	4,629
2019年8月30日	4,678
2019年9月30日	4,585
2019年10月31日	4,558
2019年11月29日	4,378
2019年12月30日	4,315
2020年1月31日	4,341
2020年2月28日	4,787
2020年3月31日	5,100
2020年4月30日	4,526

NEXT NOTES 東証マザーズ ETN 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ
第 7 期	平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「NEXT NOTES 東証マザーズ ETN」の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
2020 年 4 月 30 日現在	
2019 年 5 月 1 日～2020 年 4 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES 東証マザーズ ETN
銘柄コード	2042
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	野村證券株式会社
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
信託財産	本信託財産は、東証マザーズ指数（以下、「本指標」といいます。）に連動する債券（以下、「受託有価証券」といいます。）およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとします。また、受託者は、受託有価証券をカストディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。
信託財産の運用	受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。
収益分配方法	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

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）

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	東証マザーズ指数連動債
数量	1,200,000 口（2020 年 4 月 30 日時点）
価格	10,302,000,000 円（2020 年 4 月 30 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	8,585 円（2020 年 4 月 30 日時点）（注 3）
保管機関	受託者の指定するカストディアン

注 1：外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 2：計算期間末日（2020 年 4 月 30 日）時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注 3：外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円 (2020年4月30日現在)

注1：上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
10,302,000,000円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況 (自2019年5月1日至2020年4月30日)

1. 信託の設定、解約 (千円未満切捨て)

設定		解約	
口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)	口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)
—	—	—	—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

3. 信託業務の委託の状況

信託業務 (信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。) の第三者への委託は行っておりません。
 カストディー業務については、ルクセンブルグ三菱UFJインベスターサービス銀行 S.A. に委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末 (2020年4月30日) 現在
 (単位：千円)

資産の部		
固定資産		
投資有価証券		10,302,000
固定資産合計		10,302,000
資産合計		10,302,000
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		11,975,030
元本合計		11,975,030
留保金		
留保金合計		—
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		△1,673,030
評価・換算差額等合計		△1,673,030
元本等合計		10,302,000
負債・元本等合計		10,302,000

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分額	—
次期繰越利益	—

注1: 本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

注2: 当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■ 信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■ 収益の分配の状況について

分配金はありません。

■ 信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額 (単位: 円)
2019年5月31日	9,853
2019年6月28日	9,744
2019年7月31日	9,853
2019年8月30日	9,155
2019年9月30日	9,530
2019年10月31日	9,504
2019年11月29日	9,948
2019年12月30日	9,752
2020年1月31日	8,943
2020年2月28日	7,607
2020年3月31日	6,729
2020年4月30日	8,585

NEXT NOTES STOXX アセアン好配当50 (円、ネットリターン) ETN 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ
第 7 期	平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「NEXT NOTES STOXX アセアン好配当 50 (円、ネットリターン) ETN」の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
2020 年 4 月 30 日現在	
2019 年 5 月 1 日～2020 年 4 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES STOXX アセアン好配当 50 (円、ネットリターン) ETN
銘柄コード	2043
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	野村證券株式会社
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
信託財産	本信託財産は、STOXX アセアン好配当 50 (円、ネットリターン) (以下、「本指標」といいます。) に連動する債券 (以下、「受託有価証券」といいます。) およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとします。また、受託者は、受託有価証券をカストディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。
信託財産の運用	受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。
収益分配方法	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

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)

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	STOXX アセアン好配当 50 (円、ネットリターン) 連動債
数量	160,000 口 (2020 年 4 月 30 日時点)
価格	1,527,040,000 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	9,544 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 3)
保管機関	受託者の指定するカストディアン

注 1：外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 2：計算期間末日 (2020 年 4 月 30 日) 時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注 3：外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円 (2020年4月30日現在)

注1：上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
1,527,040,000円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況 (自2019年5月1日至2020年4月30日)

1. 信託の設定、解約 (千円未満切捨て)

設定		解約	
口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)	口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)
—	—	—	—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

3. 信託業務の委託の状況

信託業務(信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。)の第三者への委託は行っておりません。カスタディー業務については、ルクセンブルグ三菱UFJインバスターサービス銀行S.A.に委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末 (2020年4月30日) 現在
(単位：千円)

資産の部	
固定資産	
投資有価証券	1,527,040
固定資産合計	1,527,040
資産合計	1,527,040
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	1,717,700
元本合計	1,717,700
留保金	
留保金合計	—
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△190,660
評価・換算差額等合計	△190,660
元本等合計	1,527,040
負債・元本等合計	1,527,040

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分額	—
次期繰越利益	—

注1：本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

注2：当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■収益の分配の状況について

分配金はありません。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額（単位：円）
2019年5月31日	12,327
2019年6月28日	13,226
2019年7月31日	13,068
2019年8月30日	12,112
2019年9月30日	12,443
2019年10月31日	12,727
2019年11月29日	12,668
2019年12月30日	13,025
2020年1月31日	12,124
2020年2月28日	11,042
2020年3月31日	8,901
2020年4月30日	9,544

NEXT NOTES S&P500 配当貴族 (ネットリターン) ETN 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ 平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「NEXT NOTES S&P500 配当貴族 (ネットリターン) ETN」の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
第 6 期	
2020 年 4 月 30 日現在	
2019 年 5 月 1 日～2020 年 4 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES S&P500 配当貴族 (ネットリターン) ETN
銘柄コード	2044
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	野村證券株式会社
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
信託財産	本信託財産は、S&P500 配当貴族指数(課税後配当込み) (以下、「本指標」といいます。) に連動する債券 (以下、「受託有価証券」といいます。) およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとします。また、受託者は、受託有価証券をカストディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。
信託財産の運用	受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。
収益分配方法	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

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)

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	S&P500 配当貴族指数(課税後配当込み)連動債
数量	2,000,000 口 (2020 年 4 月 30 日時点)
価格	25,066,000,000 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	12,533 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 3)
保管機関	受託者の指定するカストディアン

注 1 : 外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 2 : 計算期間末日 (2020 年 4 月 30 日) 時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注 3 : 外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円 (2020年4月30日現在)

注1：上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
25,066,000,000円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況 (自2019年5月1日至2020年4月30日)

1. 信託の設定、解約 (千円未満切捨て)

設定		解約	
口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)	口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)
—	—	500,000	5,119,100

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

3. 信託業務の委託の状況

信託業務(信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。)の第三者への委託は行っておりません。カスタディー業務については、ルクセンブルグ三菱UFJインバスターサービス銀行S.A.に委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末 (2020年4月30日) 現在
(単位：千円)

資産の部	
固定資産	
投資有価証券	25,066,000
固定資産合計	25,066,000
資産合計	25,066,000
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	20,476,400
元本合計	20,476,400
留保金	
留保金合計	—
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	4,589,600
評価・換算差額等合計	4,589,600
元本等合計	25,066,000
負債・元本等合計	25,066,000

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分額	—
次期繰越利益	—

注1：本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

注2：当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■収益の分配の状況について

分配金はありません。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額（単位：円）
2019年5月31日	12,872
2019年6月28日	13,671
2019年7月31日	13,885
2019年8月30日	13,476
2019年9月30日	14,169
2019年10月31日	14,335
2019年11月29日	14,944
2019年12月30日	15,111
2020年1月31日	14,650
2020年2月28日	13,281
2020年3月31日	11,457
2020年4月30日	12,533

NEXT NOTES S&P シンガポール リート (ネットリターン) ETN 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ
第 6 期	平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「NEXT NOTES S&P シンガポール リート (ネットリターン) ETN」の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
2020 年 4 月 30 日現在	
2019 年 5 月 1 日～2020 年 4 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES S&P シンガポール リート (ネットリターン) ETN
銘柄コード	2045
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	野村證券株式会社
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
信託財産	本信託財産は、S&P シンガポール REIT 指数(課税後配当込み) (以下、「本指標」といいます。) に連動する債券 (以下、「受託有価証券」といいます。) およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとします。また、受託者は、受託有価証券をカストディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。
信託財産の運用	受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。
収益分配方法	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

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)

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	S&P シンガポール REIT 指数(課税後配当込み) 連動債
数量	200,000 口 (2020 年 4 月 30 日時点)
価格	2,204,200,000 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	11,021 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 3)
保管機関	受託者の指定するカストディアン

注 1 : 外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 2 : 計算期間末日 (2020 年 4 月 30 日) 時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注 3 : 外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円 (2020年4月30日現在)

注1：上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
2,204,200,000円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況 (自2019年5月1日至2020年4月30日)

1. 信託の設定、解約 (千円未満切捨て)

設定		解約	
口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)	口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)
—	—	—	—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

3. 信託業務の委託の状況

信託業務 (信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。) の第三者への委託は行っておりません。
 カストディー業務については、ルクセンブルグ三菱UFJインベスターサービス銀行 S.A. に委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末 (2020年4月30日) 現在
 (単位：千円)

資産の部	
固定資産	
投資有価証券	2,204,200
固定資産合計	2,204,200
資産合計	2,204,200
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	2,019,800
元本合計	2,019,800
留保金	
留保金合計	—
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	184,400
評価・換算差額等合計	184,400
元本等合計	2,204,200
負債・元本等合計	2,204,200

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分額	—
次期繰越利益	—

注1：本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

注2：当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■収益の分配の状況について

分配金はありません。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額（単位：円）
2019年5月31日	12,160
2019年6月28日	13,153
2019年7月31日	13,051
2019年8月30日	12,785
2019年9月30日	13,163
2019年10月31日	13,509
2019年11月29日	13,568
2019年12月30日	13,720
2020年1月31日	13,849
2020年2月28日	12,815
2020年3月31日	10,086
2020年4月30日	11,021

NEXT NOTES インド Nifty・ダブル・ブル ETN 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ
第 6 期	平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「NEXT NOTES インド Nifty・ダブル・ブル ETN」の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
2020 年 4 月 30 日現在	
2019 年 5 月 1 日～2020 年 4 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES インド Nifty・ダブル・ブル ETN
銘柄コード	2046
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	野村証券株式会社
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
信託財産	本信託財産は、Nifty50 レバレッジ(2倍)インデックス(プライスリターン) (以下、「本指標」といいます。)に連動する債券(以下、「受託有価証券」といいます。)およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとします。また、受託者は、受託有価証券をカストディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。
信託財産の運用	受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。
収益分配方法	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

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)

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	Nifty レバレッジ(プライスリターン)指数連動債
数量	360,000 口 (2020 年 4 月 30 日時点)
価格	2,167,920,000 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	6,022 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 3)
保管機関	受託者の指定するカストディアン

注 1 : 外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 2 : 計算期間末日(2020 年 4 月 30 日)時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注 3 : 外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円 (2020年4月30日現在)

注1：上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
2,167,920,000円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況 (自2019年5月1日至2020年4月30日)

1. 信託の設定、解約 (千円未満切捨て)

設定		解約	
口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)	口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)
—	—	—	—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

3. 信託業務の委託の状況

信託業務(信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。)の第三者への委託は行っておりません。カスタディー業務については、ルクセンブルグ三菱UFJインバスターサービス銀行S.A.に委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末 (2020年4月30日) 現在
(単位：千円)

資産の部	
固定資産	
投資有価証券	2,167,920
固定資産合計	2,167,920
資産合計	2,167,920
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	3,555,300
元本合計	3,555,300
留保金	
留保金合計	—
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△1,387,380
評価・換算差額等合計	△1,387,380
元本等合計	2,167,920
負債・元本等合計	2,167,920

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分額	—
次期繰越利益	—

注1: 本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

注2: 当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■ 信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■ 収益の分配の状況について

分配金はありません。

■ 信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額 (単位: 円)
2019年5月31日	11,128
2019年6月28日	10,832
2019年7月31日	9,673
2019年8月30日	8,889
2019年9月30日	9,782
2019年10月31日	10,412
2019年11月29日	10,689
2019年12月30日	10,998
2020年1月31日	10,347
2020年2月28日	8,855
2020年3月31日	4,672
2020年4月30日	6,022

NEXT NOTES インドNifty・ベア ETN 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ
第 6 期	平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「NEXT NOTES インドNifty・ベア ETN」の 左記決算における運用状況をご報告申し上げます。 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
2020 年 4 月 30 日現在	
2019 年 5 月 1 日～2020 年 4 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES インドNifty・ベア ETN
銘柄コード	2047
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	野村証券株式会社
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
信託財産	本信託財産は、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、「本指標」といいます。) に連動する債券 (以下、「受託有価証券」といいます。) およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとし、また、受託者は、受託有価証券をカストディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。
信託財産の運用	受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。
収益分配方法	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

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)

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	Nifty デイリーインバース(トータルリターン) 指数連動債
数量	60,000 口 (2020 年 4 月 30 日時点)
価格	409,080,000 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	6,818 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 3)
保管機関	受託者の指定するカストディアン

注 1 : 外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 2 : 計算期間末日 (2020 年 4 月 30 日) 時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注 3 : 外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円 (2020年4月30日現在)

注1：上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
409,080,000円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況 (自2019年5月1日至2020年4月30日)

1. 信託の設定、解約 (千円未満切捨て)

設定		解約	
口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)	口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)
—	—	—	—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

3. 信託業務の委託の状況

信託業務 (信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。) の第三者への委託は行っておりません。
 カストディー業務については、ルクセンブルグ三菱UFJインバスターサービス銀行 S.A. に委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末 (2020年4月30日) 現在
 (単位：千円)

資産の部	
固定資産	
投資有価証券	409,080
固定資産合計	409,080
資産合計	409,080
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	600,000
元本合計	600,000
留保金	
留保金合計	—
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△190,920
評価・換算差額等合計	△190,920
元本等合計	409,080
負債・元本等合計	409,080

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分額	—
次期繰越利益	—

注1：本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

注2：当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■収益の分配の状況について

分配金はありません。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額（単位：円）
2019年5月31日	6,552
2019年6月28日	6,643
2019年7月31日	7,126
2019年8月30日	6,765
2019年9月30日	6,658
2019年10月31日	6,432
2019年11月29日	6,364
2019年12月30日	6,283
2020年1月31日	6,412
2020年2月28日	6,734
2020年3月31日	7,951
2020年4月30日	6,818

NEXT NOTES 野村日本株高配当70 (ドルヘッジ、ネットリターン)ETN 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ
第 6 期	平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「NEXT NOTES 野村日本株高配当 70 (ドルヘッジ、ネットリターン)ETN」の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
2020 年 4 月 30 日現在	
2019 年 5 月 1 日～2020 年 4 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES 野村日本株高配当 70 (ドルヘッジ、ネットリターン)ETN
銘柄コード	2048
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	野村証券株式会社
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
信託財産	本信託財産は、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、「本指標」といいます。) に連動する債券 (以下、「受託有価証券」といいます。) およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとします。また、受託者は、受託有価証券をカストディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。
信託財産の運用	受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。
収益分配方法	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

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)

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	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) 連動債
数量	600,000 口 (2020 年 4 月 30 日時点)
価格	4,962,600,000 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	8,271 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 3)
保管機関	受託者の指定するカストディアン

注 1 : 外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 2 : 計算期間末日 (2020 年 4 月 30 日) 時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注 3 : 外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円 (2020年4月30日現在)

注1：上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
4,962,600,000円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況 (自2019年5月1日至2020年4月30日)

1. 信託の設定、解約 (千円未満切捨て)

設定		解約	
口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)	口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)
—	—	—	—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

3. 信託業務の委託の状況

信託業務 (信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。) の第三者への委託は行っておりません。
 カストディー業務については、ルクセンブルグ三菱UFJインバスターサービス銀行 S.A. に委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末 (2020年4月30日) 現在
 (単位：千円)

資産の部	
固定資産	
投資有価証券	4,962,600
固定資産合計	4,962,600
資産合計	4,962,600
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	5,821,763
元本合計	5,821,763
留保金	
留保金合計	—
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△859,163
評価・換算差額等合計	△859,163
元本等合計	4,962,600
負債・元本等合計	4,962,600

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分額	—
次期繰越利益	—

注1：本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

注2：当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■収益の分配の状況について

分配金はありません。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額（単位：円）
2019年5月31日	9,260
2019年6月28日	9,516
2019年7月31日	9,526
2019年8月30日	8,870
2019年9月30日	9,686
2019年10月31日	10,301
2019年11月29日	10,571
2019年12月30日	10,563
2020年1月31日	10,192
2020年2月28日	9,144
2020年3月31日	8,136
2020年4月30日	8,271

NEXT NOTES ニッチトップ中小型日本株（ネットリターン）ETN 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ 平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「NEXT NOTES ニッチトップ中小型日本株（ネットリターン）ETN」の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
第 1 期	
2020 年 4 月 30 日現在	
2019 年 7 月 10 日～2020 年 4 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES ニッチトップ中小型日本株（ネットリターン）ETN
銘柄コード	2050
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	野村證券株式会社
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
信託財産	本信託財産は、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）（以下、「本指標」といいます。）に連動する債券（以下、「受託有価証券」といいます。）およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとします。また、受託者は、受託有価証券をカスタディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。
信託財産の運用	受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。
収益分配方法	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

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）

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	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）連動債
数量	200,000 口（2020 年 4 月 30 日時点）
価格	1,801,000,000 円（2020 年 4 月 30 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	9,005 円（2020 年 4 月 30 日時点）（注 3）
保管機関	受託者の指定するカスタディアン

注 1：外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 2：計算期間末日（2020 年 4 月 30 日）時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注 3：外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円 (2020年4月30日現在)

注1：上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
1,801,000,000円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況 (自2019年7月10日至2020年4月30日)

1. 信託の設定、解約 (千円未満切捨て)

設定		解約	
口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)	口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)
200,000	1,992,020	—	—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

3. 信託業務の委託の状況

信託業務 (信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。) の第三者への委託は行っておりません。
 カストディー業務については、ルクセンブルグ三菱UFJインベスターサービス銀行 S.A. に委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末 (2020年4月30日) 現在
 (単位：千円)

資産の部	
固定資産	
投資有価証券	1,801,000
固定資産合計	1,801,000
資産合計	1,801,000
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	1,992,020
元本合計	1,992,020
留保金	
留保金合計	—
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△191,020
評価・換算差額等合計	△191,020
元本等合計	1,801,000
負債・元本等合計	1,801,000

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分額	—
次期繰越利益	—

注1：本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

注2：当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■収益の分配の状況について

分配金はありません。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額（単位：円）
2019年5月31日	—
2019年6月28日	—
2019年7月31日	9,982
2019年8月30日	9,478
2019年9月30日	10,074
2019年10月31日	10,800
2019年11月29日	11,041
2019年12月30日	11,271
2020年1月31日	10,569
2020年2月28日	9,254
2020年3月31日	8,527
2020年4月30日	9,005

NEXT NOTES 日本株配当貴族（ドルヘッジ、ネットリターン）ETN 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ
第 4 期	平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「NEXT NOTES 日本株配当貴族（ドルヘッジ、ネットリターン）ETN」の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
2020 年 4 月 30 日現在	
2019 年 5 月 1 日～2020 年 4 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES 日本株配当貴族（ドルヘッジ、ネットリターン）ETN
銘柄コード	2065
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	野村証券株式会社
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
信託財産	本信託財産は、S&P/JPX 配当貴族指数（米ドルヘッジ、課税後配当込み）（以下、「本指標」といいます。）に連動する債券（以下、「受託有価証券」といいます。）およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとします。また、受託者は、受託有価証券をカスタディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。
信託財産の運用	受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。
収益分配方法	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

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）

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	S&P/JPX 配当貴族指数（米ドルヘッジ、課税後配当込み）連動債
数量	200,000 口（2020 年 4 月 30 日時点）
価格	1,954,600,000 円（2020 年 4 月 30 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	9,773 円（2020 年 4 月 30 日時点）（注 3）
保管機関	受託者の指定するカスタディアン

注 1：外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 2：計算期間末日（2020 年 4 月 30 日）時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注 3：外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円 (2020年4月30日現在)

注1：上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
1,954,600,000円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況 (自2019年5月1日至2020年4月30日)

1. 信託の設定、解約 (千円未満切捨て)

設定		解約	
口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)	口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)
—	—	—	—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

3. 信託業務の委託の状況

信託業務 (信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。) の第三者への委託は行っておりません。
 カストディー業務については、ルクセンブルグ三菱UFJインベスターサービス銀行 S.A. に委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末 (2020年4月30日) 現在
 (単位：千円)

資産の部	
固定資産	
投資有価証券	1,954,600
固定資産合計	1,954,600
資産合計	1,954,600
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	2,000,000
元本合計	2,000,000
留保金	
留保金合計	—
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△45,400
評価・換算差額等合計	△45,400
元本等合計	1,954,600
負債・元本等合計	1,954,600

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分額	—
次期繰越利益	—

注1：本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

注2：当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■ 信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■ 収益の分配の状況について

分配金はありません。

■ 信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額（単位：円）
2019年5月31日	10,364
2019年6月28日	10,517
2019年7月31日	10,657
2019年8月30日	9,838
2019年9月30日	10,745
2019年10月31日	11,372
2019年11月29日	11,830
2019年12月30日	12,132
2020年1月31日	11,602
2020年2月28日	10,380
2020年3月31日	9,562
2020年4月30日	9,773

NEXT NOTES 東証 REIT (ドルヘッジ、ネットリターン) ETN 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ
第 4 期	平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「NEXT NOTES 東証 REIT (ドルヘッジ、ネットリターン) ETN」の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
2020 年 4 月 30 日現在	
2019 年 5 月 1 日～2020 年 4 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES 東証 REIT (ドルヘッジ、ネットリターン) ETN
銘柄コード	2066
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	野村証券株式会社
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
信託財産	本信託財産は、税引後配当込東証 REIT 米ドルヘッジ指数 (以下、「本指標」といいます。) に連動する債券 (以下、「受託有価証券」といいます。) およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとします。また、受託者は、受託有価証券をカストディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。
信託財産の運用	受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。
収益分配方法	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

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)

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	税引後配当込東証 REIT 米ドルヘッジ指数連動債
数量	300,000 口 (2020 年 4 月 30 日時点)
価格	2,974,200,000 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	9,914 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 3)
保管機関	受託者の指定するカストディアン

注 1 : 外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 2 : 計算期間末日 (2020 年 4 月 30 日) 時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注 3 : 外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円 (2020年4月30日現在)

注1：上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
2,974,200,000円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況 (自2019年5月1日至2020年4月30日)

1. 信託の設定、解約 (千円未満切捨て)

設定		解約	
口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)	口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)
—	—	—	—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

3. 信託業務の委託の状況

信託業務(信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。)の第三者への委託は行っておりません。カスタディー業務については、ルクセンブルグ三菱UFJインバスターサービス銀行S.A.に委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末 (2020年4月30日) 現在
(単位：千円)

資産の部	
固定資産	
投資有価証券	2,974,200
固定資産合計	2,974,200
資産合計	2,974,200
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	2,932,300
元本合計	2,932,300
留保金	
留保金合計	—
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	41,900
評価・換算差額等合計	41,900
元本等合計	2,974,200
負債・元本等合計	2,974,200

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分額	—
次期繰越利益	—

注1：本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

注2：当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■収益の分配の状況について

分配金はありません。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額（単位：円）
2019年5月31日	11,701
2019年6月28日	11,800
2019年7月31日	12,421
2019年8月30日	12,621
2019年9月30日	13,462
2019年10月31日	13,927
2019年11月29日	13,994
2019年12月30日	13,538
2020年1月31日	13,952
2020年2月28日	12,706
2020年3月31日	10,095
2020年4月30日	9,914

NEXT NOTES 野村 AI ビジネス70(ネットリターン) ETN 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ
第 4 期	平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「NEXT NOTES 野村 AI ビジネス 70(ネットリターン) ETN」の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
2020 年 4 月 30 日現在	
2019 年 5 月 1 日～2020 年 4 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES 野村 AI ビジネス 70(ネットリターン) ETN
銘柄コード	2067
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	野村証券株式会社
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
信託財産	本信託財産は、野村 AI ビジネス 70(配当課税考慮済指数) (以下、「本指標」といいます。) に連動する債券 (以下、「受託有価証券」といいます。) およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとします。また、受託者は、受託有価証券をカストディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。
信託財産の運用	受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。
収益分配方法	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

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)

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	野村 AI ビジネス 70(ネットリターン)連動債
数量	600,000 口 (2020 年 4 月 30 日時点)
価格	5,324,400,000 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	8,874 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 3)
保管機関	受託者の指定するカストディアン

注 1：外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 2：計算期間末日 (2020 年 4 月 30 日) 時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注 3：外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円 (2020年4月30日現在)

注1：上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
5,324,400,000円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況 (自2019年5月1日至2020年4月30日)

1. 信託の設定、解約 (千円未満切捨て)

設定		解約	
口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)	口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)
—	—	—	—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

3. 信託業務の委託の状況

信託業務 (信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。) の第三者への委託は行っておりません。
 カストディー業務については、ルクセンブルグ三菱UFJインベスターサービス銀行 S.A. に委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末 (2020年4月30日) 現在
 (単位：千円)

資産の部	
固定資産	
投資有価証券	5,324,400
固定資産合計	5,324,400
資産合計	5,324,400
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	6,822,100
元本合計	6,822,100
留保金	
留保金合計	—
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△1,497,700
評価・換算差額等合計	△1,497,700
元本等合計	5,324,400
負債・元本等合計	5,324,400

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分額	—
次期繰越利益	—

注1：本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

注2：当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■収益の分配の状況について

分配金はありません。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額（単位：円）
2019年5月31日	9,999
2019年6月28日	10,289
2019年7月31日	10,294
2019年8月30日	9,915
2019年9月30日	10,475
2019年10月31日	10,938
2019年11月29日	10,982
2019年12月30日	11,088
2020年1月31日	10,856
2020年2月28日	9,699
2020年3月31日	8,509
2020年4月30日	8,874

NEXT NOTES 高ベータ30(ネットリターン) ETN 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ
第 4 期	平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「NEXT NOTES 高ベータ 30(ネットリターン) ETN」の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
2020 年 4 月 30 日現在	
2019 年 5 月 1 日～2020 年 4 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES 高ベータ 30(ネットリターン) ETN
銘柄コード	2068
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	野村証券株式会社
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
信託財産	<p>本信託財産は、野村日本株高ベータ・セレクト 30 (配当課税考慮済指数) (以下、「本指標」といいます。) に連動する債券 (以下、「受託有価証券」といいます。) およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとします。また、受託者は、受託有価証券をカスタディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。</p>
信託財産の運用	<p>受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。</p>
収益分配方法	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

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)

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	野村日本株高ベータ・セレクト 30(ネットリターン)連動債
数量	200,000 口 (2020 年 4 月 30 日時点)
価格	1,708,400,000 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	8,542 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 3)
保管機関	受託者の指定するカスタディアン

注 1 : 外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 2 : 計算期間末日 (2020 年 4 月 30 日) 時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注 3 : 外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円 (2020年4月30日現在)

注1：上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
1,708,400,000円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況 (自2019年5月1日至2020年4月30日)

1. 信託の設定、解約 (千円未満切捨て)

設定		解約	
口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)	口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)
—	—	—	—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

3. 信託業務の委託の状況

信託業務 (信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。) の第三者への委託は行っておりません。
 カストディー業務については、ルクセンブルグ三菱UFJインベスターサービス銀行 S.A. に委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末 (2020年4月30日) 現在
 (単位：千円)

資産の部	
固定資産	
投資有価証券	1,708,400
固定資産合計	1,708,400
資産合計	1,708,400
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	2,095,000
元本合計	2,095,000
留保金	
留保金合計	—
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△386,600
評価・換算差額等合計	△386,600
元本等合計	1,708,400
負債・元本等合計	1,708,400

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分額	—
次期繰越利益	—

注1：本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

注2：当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■収益の分配の状況について

分配金はありません。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額（単位：円）
2019年5月31日	8,709
2019年6月28日	9,166
2019年7月31日	9,198
2019年8月30日	8,570
2019年9月30日	9,259
2019年10月31日	9,827
2019年11月29日	9,846
2019年12月30日	10,136
2020年1月31日	9,773
2020年2月28日	8,844
2020年3月31日	7,727
2020年4月30日	8,542

NEXT NOTES 低ベータ50(ネットリターン) ETN 信託財産状況報告書

信託契約第 29 条に基づく報告書 (信託財産状況報告書を含みます。)	受益者の皆様へ
第 4 期	平素は格別のお引き立てにあずかり厚く御礼申し上げます。 受益証券発行信託「NEXT NOTES 低ベータ 50(ネットリターン) ETN」の左記決算における運用状況をご報告申し上げます。 今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。
2020 年 4 月 30 日現在	
2019 年 5 月 1 日～2020 年 4 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES 低ベータ 50(ネットリターン) ETN
銘柄コード	2069
信託期間	信託設定の日から信託終了の日まで
委託者	野村證券株式会社
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
信託財産	本信託財産は、野村日本株低ベータ・セレクト 50(配当課税考慮済指数) (以下、「本指標」といいます。) に連動する債券 (以下、「受託有価証券」といいます。) およびこれらに係る金銭等ならびに信託契約に基づいて受託者が受領する金銭その他の財産により構成されますが、消費税の授受または信託報酬もしくは信託費用の支払い等のために一時的に本信託財産となる金銭等を除き、受託有価証券のみとなります。なお、受託者は、信託法および信託業法に従い、本信託財産を固有財産および他の信託財産と分別して管理するものとします。また、受託者は、受託有価証券をカスタディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。
信託財産の運用	受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。
収益分配方法	原則として、信託期間中に分配は行いません。

■信託財産を構成する資産の内容

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)

資産の種類	外国指標連動証券
資産の名称	野村日本株低ベータ・セレクト 50(ネットリターン)連動債
数量	200,000 口 (2020 年 4 月 30 日時点)
価格	2,169,800,000 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	10,849 円 (2020 年 4 月 30 日時点) (注 3)
保管機関	受託者の指定するカスタディアン

注 1 : 外国指標連動証券の残存償還価格の総額を記載しております。

注 2 : 計算期間末日 (2020 年 4 月 30 日) 時点における外国指標連動証券の価格を記載しております。

注 3 : 外国指標連動証券の一口あたりの償還価格を記載しております。

2. 金銭

資産の種類	金銭
価 格	0円 (2020年4月30日現在)

注1：上記金銭は、受託者の銀行勘定で預かります。

■受益証券発行信託の状況

本信託の純資産総額
2,169,800,000円

注1：決算期日末日時点の状況です。日々の状況につきましては、東京証券取引所の適時開示情報閲覧サービス(TDnet)をご覧ください。

■取引の状況 (自2019年5月1日至2020年4月30日)

1. 信託の設定、解約 (千円未満切捨て)

設定		解約	
口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)	口数 (単位：口)	金額 (単位：千円)
—	—	—	—

2. 自己またはその利害関係人等との取引状況

該当事項はありません。

3. 信託業務の委託の状況

信託業務(信託業法第22条第3項各号に掲げる業務を除きます。)の第三者への委託は行っておりません。カスタディー業務については、ルクセンブルグ三菱UFJインバスターサービス銀行S.A.に委託しております。

■資産、負債、元本、純資産価額および損益の状況

<貸借対照表>

当計算期間末 (2020年4月30日) 現在
(単位：千円)

資産の部	
固定資産	
投資有価証券	2,169,800
固定資産合計	2,169,800
資産合計	2,169,800
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	2,066,200
元本合計	2,066,200
留保金	
留保金合計	—
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	103,600
評価・換算差額等合計	103,600
元本等合計	2,169,800
負債・元本等合計	2,169,800

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
当期純利益	—
前期繰越利益	—
当期末処分利益	—
利益処分額	—
次期繰越利益	—

注1：本損益計算書は、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律施行規則第19条第2項に定める「収支計算書」を兼ねております。

注2：当計算期間において損益等の発生する取引は生じておりません。

■信託財産の銀行勘定への運用について

該当事項はございません。

■収益の分配の状況について

分配金はありません。

■信託財産の価額の推移

日付	一口あたりの信託財産の価額（単位：円）
2019年5月31日	10,613
2019年6月28日	10,632
2019年7月31日	10,674
2019年8月30日	10,624
2019年9月30日	11,183
2019年10月31日	11,775
2019年11月29日	12,063
2019年12月30日	12,118
2020年1月31日	12,041
2020年2月28日	10,597
2020年3月31日	10,720
2020年4月30日	10,849