



令和3年11月12日

各位

ETN 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
問 合 せ 先	野 村 證 券 株 式 会 社 ストラクチャード・プロダクト部 野村 正明 TEL 03-3211-1811

## 「NEXT NOTES 日経平均 VI 先物指数 ETN」の信託の終了に係る信託契約の変更及び 催告の対象となる受益者確定のための権利確定日の設定に関するお知らせ

当社は、「NEXT NOTES 日経平均 VI 先物指数 ETN」(銘柄コード:2035)(以下「当 ETN/JDR」といいます。)について、信託法第 149 条第 4 項、「日経平均 VI 先物指数連動債上場信託受益権信託契約及び発行会社に係る契約に関する個別契約書」(以下「本信託契約」といいます。)第 4 条及び「上場信託受益権信託契約及び発行会社に係る契約条項」(以下「本契約条項」といいます。)第 52 条第 3 項の規定に基づき「非軽微な信託の変更」として、信託の終了に係る本信託契約の変更を予定しております。本信託契約の変更に関し、令和 3 年 11 月 26 日を権利確定日と定め、当該権利確定日における受益者(本契約条項に定義される意味を有します。以下同じです。)を「知っている受益者」として「催告」の対象となる受益者と決定いたしましたので、以下のとおりお知らせいたします。

なお、本信託契約の変更が決定された場合、令和 4 年 2 月 15 日で本信託契約の変更を実施し、令和 4 年 3 月 18 日を信託終了日として、信託の終了を行う予定です。

### 1. 本信託契約の変更及び信託の終了に関する日程(予定)

- |                  |               |
|------------------|---------------|
| ・対象受益者の権利確定日     | 令和3年11月26日(金) |
| ・受益者への催告書類発送     | 令和3年12月24日(金) |
| ・受益者による異議申立期限    | 令和4年2月10日(木)  |
| ・異議申立結果開示        | 令和4年2月15日(火)  |
| ・本信託契約の変更実施日(予定) | 令和4年2月15日(火)  |
| ・取得請求開始日(予定)     | 令和4年2月16日(水)  |
| ・取得請求終了日(予定)     | 令和4年3月7日(月)   |
| ・信託終了日(予定)       | 令和4年3月18日(金)  |
| ・残余財産給付開始日(予定)   | 令和4年4月27日(水)  |

## 2. 東京証券取引所における売買に関する日程(予定)

- ・「監理銘柄(確認中)」への指定 令和3年11月12日(金)
- ・「整理銘柄」への指定 令和4年2月15日(火)
- ・東京証券取引所における最終売買日 令和4年3月16日(水)
- ・上場廃止日 令和4年3月17日(木)

なお、最終売買日までは東京証券取引所での売買が可能です。

## 3. 本信託契約変更の内容及び理由

(変更の内容)

信託終了日を令和4年3月18日(予定)といたします。

(変更の理由)

当社及び当社グループは、投資家のニーズ動向、商品性維持等の観点から、提供する商品について継続的に見直しを行っております。

当 ETN/JDR は、日経平均ボラティリティー・インデックス先物指数を連動対象とする商品として平成25年4月上場しました。当 ETN/JDR は、将来のボラティリティーへの投資を行う商品として活用されてきましたが、連動対象は先物をロールオーバーして行く指数であるところ、過去のマーケット環境においては先物価格の期先高が優勢であったことなどもあって大きく値下がりしており、その取引価格は令和3年11月11日時点で118円となっております。

今後、市場環境次第で更に取引価格が低下した場合、取引価格は1円単位でしか変動しないため、連動対象指標との十分な連動性が得られなくなるおそれがあります。

本件への対応策としては、当 ETN/JDR の受益権の口数を併合し取引価格を引き上げる方法がありますが、併合に伴い生じる1口未満の端数部分については現金化されます。また、今後の値動きによっては追加的な併合が必要となる可能性があります。

このような状況を踏まえ、総合的に検討した結果、信託を終了させる手続が取られることになりました。

(本信託契約の新旧対照表(案))

下線部は変更部分を示します。

新	旧
<u>第3条の2 本契約条項第60条の規定にかかわらず、本信託は、令和4年3月18日の経過により終了します。</u>	(新設)

## 4. 異議申立の判定

上記権利確定日における受益者は、本信託契約の変更に関し、令和3年12月24日に発送予定の催告書類によってお知らせする所定の手続に従って、異議申立期間(令和3年12月24日から令和4年2月10日まで)中に、当 ETN/JDR の受託者である三菱 UFJ 信託銀行株式会社に対して、異議を述べることができます。

当該異議申立期間中に、異議を述べた受益者の有する本受益権(本契約条項に定義される意味を有します。以下同じです。)の口数が、総受益権口数の2分の1を超えなかった場合には、令和4年2月15日付で本信託契約の変更を実施し、令和4年3月18日を信託終了日として、信託を終了いたします。

ただし、上記の結果に至らなかった場合には、本信託契約の変更及び信託の終了は中止されます。その場合、本信託契約の変更及び信託の終了を行わないこと並びにその理由を速やかに開示いたします。

## 5. 異議を述べた受益者の受益権取得請求手続

上記異議申立期間中に異議を述べた受益者に限り、本信託契約の変更が実施され信託の終了となる場合、令和4年2月16日から令和4年3月7日までの間に、当ETN/JDRの受託者である三菱UFJ信託銀行株式会社に対して、原則として権利確定日である令和3年11月26日時点で有する本受益権の口数を上限として、本契約条項第53条第2項及び本信託契約第3条の規定に基づき算定される価額(原則として本受益権1口あたり当該異議申立期間の最終日の翌営業日(但し、同日が請求除外日である場合、又は当該日において本外国指標連動証券(本契約条項及び本信託契約に定義される意味を有します。以下同じです。)の要項に定めるMarket Disruption Event、Additional Disruption Event 若しくはIndex Adjustment Eventが発生した場合には、その直後の請求除外日ではない日であって当該事由が発生していない日とします。)現在の本外国指標連動証券1口あたりの償還価額の99.95%に受益権付与率を除いて算定される価額(1円未満の端数は切り上げます。))にて、所定の手続きに従って、取得請求することができます(ただし、取得請求と同時に、取得請求の対象となる本受益権を受託者が指定した口座に振り替えていただく必要があるため、取得請求を受付した日において有する本受益権の口数が当該権利確定日に有する本受益権の口数以下となる場合には、取得請求を受付した日において有する本受益権の口数に限られます。))。

なお、異議を述べられた受益者が必ず取得請求をしなければならないわけではありません。最終売買日までは、東京証券取引所での売買が可能であり、また、信託終了日まで保有し、残余財産給付開始日以降、残余財産の給付を受けることも可能です。

## 6. 残余財産の給付

本信託契約の変更がなされた場合、本契約条項第64条及び本信託契約第3条の規定に基づいて、信託終了日である令和4年3月18日(予定)を残余財産の給付を受ける権利に係る権利確定日とし、当該権利確定日における受益者に対し、残余財産給付開始日(令和4年4月27日(予定))以降、残余財産の給付として金銭(原則として本外国指標連動証券を処分して受領した金額(外貨を受領した場合には円貨に転換いたします。))から手数料及びこれに係る源泉徴収額、消費税等の相当額並びに信託費用を控除した金額)の支払いを行う予定です。

以上