

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  
 ストラクチャード・プロダクト部  
 野村 正明 03-3211-1811

## 2021年4月期(2020年5月1日~2021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	<a href="#">NEXT NOTES 香港ハンセン・ダブル・ブル ETN</a>	2031	東
2	<a href="#">NEXT NOTES 香港ハンセン・ベア ETN</a>	2032	東
3	<a href="#">NEXT NOTES 韓国 KOSPI・ダブル・ブル ETN</a>	2033	東
4	<a href="#">NEXT NOTES 韓国 KOSPI・ベア ETN</a>	2034	東
5	<a href="#">NEXT NOTES 日経平均 VI 先物指数 ETN</a>	2035	東
6	<a href="#">NEXT NOTES 金先物 ダブル・ブル ETN</a>	2036	東
7	<a href="#">NEXT NOTES 金先物 ベア ETN</a>	2037	東
8	<a href="#">NEXT NOTES ドバイ原油先物 ダブル・ブル ETN</a>	2038	東
9	<a href="#">NEXT NOTES ドバイ原油先物 ベア ETN</a>	2039	東
10	<a href="#">NEXT NOTES NY ダウ・ダブル・ブル・ドルヘッジ ETN</a>	2040	東
11	<a href="#">NEXT NOTES NY ダウ・ベア・ドルヘッジ ETN</a>	2041	東
12	<a href="#">NEXT NOTES 東証マザーズ ETN</a>	2042	東
13	<a href="#">NEXT NOTES STOXX アセアン好配当 50 (円、ネットリターン) ETN</a>	2043	東
14	<a href="#">NEXT NOTES S&amp;P500 配当貴族 (ネットリターン) ETN</a>	2044	東
15	<a href="#">NEXT NOTES S&amp;P シンガポールリート (ネットリターン) ETN</a>	2045	東
16	<a href="#">NEXT NOTES インド Nifty・ダブル・ブル ETN</a>	2046	東
17	<a href="#">NEXT NOTES インド Nifty・ベア ETN</a>	2047	東
18	<a href="#">NEXT NOTES 野村日本株高配当 70 (ドルヘッジ、ネットリターン) ETN</a>	2048	東
19	<a href="#">NEXT NOTES ニッチトップ 中小型日本株 (ネットリターン) ETN</a>	2050	東
20	<a href="#">NEXT NOTES 日本株配当貴族 (ドルヘッジ、ネットリターン) ETN</a>	2065	東
21	<a href="#">NEXT NOTES 東証 REIT (ドルヘッジ、ネットリターン) ETN</a>	2066	東
22	<a href="#">NEXT NOTES 野村 AI ビジネス 70 (ネットリターン) ETN</a>	2067	東
23	<a href="#">NEXT NOTES 高ベータ 30 (ネットリターン) ETN</a>	2068	東
24	<a href="#">NEXT NOTES 低ベータ 50 (ネットリターン) ETN</a>	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。

以上

## 掲載番号 1

# 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 9 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。
2021 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。
2020 年 5 月 1 日～2021 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・レバレッジインデックス連動債
数量	100,000 口（2021 年 4 月 30 日時点）
価格	1,192,900,000 円（2021 年 4 月 30 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	11,929 円（2021 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（2021 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（注）
価 格	0円（2021年4月30日現在）

注：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（注）
1,192,900,000円

注：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2020年5月1日 至2021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）
—	—	160,000	1,971,630

#### 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、ルクセンブルク三菱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（2021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	1,192,900
固定資産合計	1,192,900
資産合計	1,192,900
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	1,232,269
元本合計	1,232,269
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	△39,369
評価・換算差額等合計	△39,369
元本等合計	1,192,900
負債・元本等合計	1,192,900

<損益計算書（注1）（注2）>

当計算期間（自 2020年5月1日 至 2021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	—
当期未処分利益	—
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）
2020年5月29日	7,884
2020年6月30日	8,889
2020年7月31日	8,775
2020年8月31日	9,190
2020年9月30日	7,918
2020年10月30日	8,253
2020年11月30日	9,796
2020年12月30日	10,277
2021年1月29日	11,255
2021年2月26日	11,951
2021年3月31日	11,794
2021年4月30日	11,929

## 掲載番号2

### 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 9 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。
2021 年 4 月 30 日現在	
2020 年 5 月 1 日～2021 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・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（2021 年 4 月 30 日時点）
価格	316,620,000 円（2021 年 4 月 30 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	5,277 円（2021 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（2021 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（注）
価 格	0 円（2021 年 4 月 30 日現在）

注：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（注）
316,620,000 円

注：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 2020 年 5 月 1 日 至 2021 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、ルクセンブルク三菱 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（2021 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	316,620
固定資産合計	316,620
資産合計	316,620
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	△283,380
評価・換算差額等合計	△283,380

元本等合計	316,620
負債・元本等合計	316,620

<損益計算書（注1）（注2）>

当計算期間（自 2020年5月1日 至 2021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	—
当期未処分利益	—
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）
2020年5月29日	7,018
2020年6月30日	6,511
2020年7月31日	6,245
2020年8月31日	6,088
2020年9月30日	6,459
2020年10月30日	6,204
2020年11月30日	5,639
2020年12月30日	5,405
2021年1月29日	5,234
2021年2月26日	5,168
2021年3月31日	5,415
2021年4月30日	5,277

## 掲載番号3

# 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 9 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。
2021 年 4 月 30 日現在	
2020 年 5 月 1 日～2021 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、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	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（2021 年 4 月 30 日時点）
価格	1,181,520,000 円（2021 年 4 月 30 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	19,692 円（2021 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（2021 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（注）
価 格	0円（2021年4月30日現在）

注：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（注）
1,181,520,000円

注：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2020年5月1日 至2021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、ルクセンブルク三菱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（2021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	1,181,520
固定資産合計	1,181,520
資産合計	1,181,520
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	581,520

評価・換算差額等合計	581,520
元本等合計	1,181,520
負債・元本等合計	1,181,520

<損益計算書（注1）（注2）>

当計算期間（自 2020年5月1日 至 2021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	—
当期未処分利益	—
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）
2020年5月29日	7,443
2020年6月30日	8,271
2020年7月31日	9,313
2020年8月31日	9,813
2020年9月30日	10,030
2020年10月30日	9,701
2020年11月30日	13,004
2020年12月30日	16,526
2021年1月29日	17,413
2021年2月26日	18,001
2021年3月31日	18,939
2021年4月30日	19,692

## 掲載番号4

# 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 9 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。
2021 年 4 月 30 日現在	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。
2020 年 5 月 1 日～2021 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 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	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	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 (2021 年 4 月 30 日時点)
価格	901,200,000 円 (2021 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	6,008 円 (2021 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 (2021 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（注）
価 格	0円（2021年4月30日現在）

注：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（注）
901,200,000円

注：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2020年5月1日至2021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、ルクセンブルク三菱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（2021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	901,200
固定資産合計	901,200
資産合計	901,200
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	△663,330

評価・換算差額等合計	△663,330
元本等合計	901,200
負債・元本等合計	901,200

<損益計算書（注1）（注2）>

当計算期間（自 2020年5月1日 至 2021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	—
当期未処分利益	—
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）
2020年5月29日	8,984
2020年6月30日	8,692
2020年7月31日	8,047
2020年8月31日	7,867
2020年9月30日	7,830
2020年10月30日	8,196
2020年11月30日	7,262
2020年12月30日	6,425
2021年1月29日	6,035
2021年2月26日	6,000
2021年3月31日	6,084
2021年4月30日	6,008

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 9 期	
2021 年 4 月 30 日現在	
2020 年 5 月 1 日～2021 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	日経平均 VI 先物指数連動債 2（注 1）
数量	31,895,000 口（2021 年 4 月 30 日時点）
価格	7,622,905,000 円（2021 年 4 月 30 日時点）（注 2）（注 3）
一口あたりの価格	239 円（2021 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（2021 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（注）
価 格	0円（2021年4月30日現在）

注：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（注）
7,622,905,000円

注：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2020年5月1日至2021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）
17,200,000	5,688,000	—	—

#### 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。

カスタディー業務については、ルクセンブルク三菱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（2021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	7,622,905
固定資産合計	7,622,905
資産合計	7,622,905
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	38,002,544
元本合計	38,002,544
留保金	
次期繰越損失（△）	△30,379,639
留保金合計	△30,379,639
評価・換算差額等	

評価・換算差額等合計	—
元本等合計	7,622,905
負債・元本等合計	7,622,905

<損益計算書（注1）>

当計算期間（自 2020年5月1日 至 2021年4月30日）

（単位：千円）

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	23,546,635
当期純損失（△）	△23,546,635
前期繰越損失（△）	△6,833,004
当期未処理損失（△）	△30,379,639
次期繰越損失（△）	△30,379,639

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）
2020年5月29日	851
2020年6月30日	887
2020年7月31日	661
2020年8月31日	540
2020年9月30日	462
2020年10月30日	414
2020年11月30日	371
2020年12月30日	333
2021年1月29日	408
2021年2月26日	363
2021年3月31日	287
2021年4月30日	239

NEXT NOTES 金先物 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  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 金先物 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。
第 9 期	
2021 年 4 月 30 日現在	
2020 年 5 月 1 日～2021 年 4 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES 金先物 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	本信託財産は、日経・JPX 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	日経・JPX 金レバレッジ指数連動債（注 1）
数量	250,000 口（2021 年 4 月 30 日時点）
価格	4,224,500,000 円（2021 年 4 月 30 日時点）（注 2）（注 3）
一口あたりの価格	16,898 円（2021 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 1：2020年7月27日を以って、信託財産を構成する資産の名称は「日経・東商取金レバレッジ指数連動債」から「日経・JPX金レバレッジ指数連動債」に変更されています。

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（2021 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（注）
価 格	0円（2021年4月30日現在）

注：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（注）
4,224,500,000円

注：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2020年5月1日 至2021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、ルクセンブルク三菱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（2021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	4,224,500
固定資産合計	4,224,500
資産合計	4,224,500
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	1,961,940
評価・換算差額等合計	1,961,940
元本等合計	4,224,500
負債・元本等合計	4,224,500

<損益計算書（注1）（注2）>

当計算期間（自 2020年5月1日 至 2021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	—
当期未処分利益	—
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）
2020年5月29日	16,027
2020年6月30日	17,144
2020年7月31日	19,919
2020年8月31日	20,105
2020年9月30日	18,327
2020年10月30日	17,595
2020年11月30日	15,606
2020年12月30日	17,496
2021年1月29日	17,085
2021年2月26日	16,053
2021年3月31日	15,976
2021年4月30日	16,898

## 掲載番号7

# NEXT NOTES 金先物 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  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 金先物 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。
第 9 期	
2021 年 4 月 30 日現在	
2020 年 5 月 1 日～2021 年 4 月 30 日	

### ■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES 金先物 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	本信託財産は、日経・JPX 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・JPX金インバース指数連動債（注1）
数量	100,000口（2021年4月30日時点）
価格	573,100,000円（2021年4月30日時点）（注2）（注3）
一口あたりの価格	5,731円（2021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1：2020年7月27日を以って、信託財産を構成する資産の名称は「日経・東商取金インバース指数連動債」から「日経・JPX金インバース指数連動債」に変更されています。

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（2021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（注）
価 格	0円（2021年4月30日現在）

注：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（注）
573,100,000円

注：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2020年5月1日 至2021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、ルクセンブルク三菱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（2021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	573,100
固定資産合計	573,100
資産合計	573,100
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	△278,140
評価・換算差額等合計	△278,140
元本等合計	573,100
負債・元本等合計	573,100

<損益計算書（注1）（注2）>                      当計算期間（自 2020年5月1日 至 2021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	—
当期未処分利益	—
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）
2020年5月29日	6,129
2020年6月30日	5,913
2020年7月31日	5,465
2020年8月31日	5,392
2020年9月30日	5,621
2020年10月30日	5,723
2020年11月30日	6,048
2020年12月30日	5,693
2021年1月29日	5,744
2021年2月26日	5,909
2021年3月31日	5,905
2021年4月30日	5,731

## 掲載番号 8

# NEXT NOTES ドバイ原油先物 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 9 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 ドバイ原油先物 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。
2021 年 4 月 30 日現在	
2020 年 5 月 1 日～2021 年 4 月 30 日	

### ■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES ドバイ原油先物 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・JPX 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	日経・JPX原油レバレッジ指数連動債 3（注1）
数量	265,000,000 口（2021 年 4 月 30 日時点）
価格	133,825,000,000 円（2021 年 4 月 30 日時点）（注2）（注3）
一口あたりの価格	505 円（2021 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1：2020年7月27日を以って、信託財産を構成する資産の名称は「日経・東商取原油レバレッジ指数連動債3」から「日経・JPX原油レバレッジ指数連動債3」に変更されています。

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（2021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（注）
価 格	0円（2021年4月30日現在）

注：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（注）
133,825,000,000円

注：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2020年5月1日 至2021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）
200,000,000	35,900,000	380,000,000	61,786,821

#### 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、ルクセンブルク三菱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（2021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	133,825,000
固定資産合計	133,825,000
資産合計	133,825,000
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	83,890,727
元本合計	83,890,727
留保金（繰越損失）	
次期繰越損失（△）	△40,802,548
留保金合計	△40,802,548

評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	90,736,821
評価・換算差額等合計	90,736,821
元本等合計	133,825,000
負債・元本等合計	133,825,000

<損益計算書（注1）>

当計算期間（自 2020年5月1日 至 2021年4月30日）

（単位：千円）

経常収益	—
経常費用	—
経常利益	—
特別利益	—
投資有価証券評価損	—
当期純損失（△）	—
前期繰越損失（△）	△99,311,864
当期一部解約に伴う前期繰越損失 の減少額	58,509,316
当期未処理損失（△）	△40,802,548
次期繰越損失（△）	△40,802,548

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）
2020年5月29日	218
2020年6月30日	247
2020年7月31日	253
2020年8月31日	286
2020年9月30日	221
2020年10月30日	174
2020年11月30日	251
2020年12月30日	286
2021年1月29日	331
2021年2月26日	458
2021年3月31日	482
2021年4月30日	505

NEXT NOTES ドバイ原油先物 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  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 ドバイ原油先物 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。
第 9 期	
2021 年 4 月 30 日現在	
2020 年 5 月 1 日～2021 年 4 月 30 日	

■受益証券発行信託の概要

商品名	NEXT NOTES ドバイ原油先物 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	本信託財産は、日経・JPX 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。
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・JPX原油インバース指数連動債（注1）
数量	700,000口（2021年4月30日時点）
価格	2,590,000,000円（2021年4月30日時点）（注2）（注3）
一口あたりの価格	3,700円（2021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1：2020年7月27日を以って、信託財産を構成する資産の名称は「日経・東商取原油インバース指数連動債」から「日経・JPX原油インバース指数連動債」に変更されています。

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（2021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（注）
価 格	0円（2021年4月30日現在）

注：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（注）
2,590,000,000円

注：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2020年5月1日至2021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）
300,000	1,254,000	300,000	3,438,171

#### 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。

カストディ業務については、ルクセンブルク三菱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（2021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	2,590,000
固定資産合計	2,590,000
資産合計	2,590,000
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	5,838,228
元本合計	5,838,228
留保金	
次期繰越損失（△）	△3,248,228
留保金合計	△3,248,228

評価・換算差額等	
評価・換算差額等合計	—
元本等合計	2,590,000
負債・元本等合計	2,590,000

<損益計算書（注1）>

当計算期間（自 2020年5月1日 至 2021年4月30日）

（単位：千円）

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	3,248,228
当期純損失（△）	△3,248,228
前期繰越損失（△）	—
当期未処理損失（△）	△3,248,228
次期繰越損失（△）	△3,248,228

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）
2020年5月29日	7,057
2020年6月30日	6,282
2020年7月31日	6,150
2020年8月31日	5,765
2020年9月30日	6,405
2020年10月30日	7,040
2020年11月30日	5,648
2020年12月30日	5,240
2021年1月29日	4,814
2021年2月26日	4,040
2021年3月31日	3,829
2021年4月30日	3,700

## 掲載番号10

# 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
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 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。
2021 年 4 月 30 日現在	
2020 年 5 月 1 日～2021 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	460,000口(2021年4月30日時点)
価格	13,782,520,000円(2021年4月30日時点)(注1)(注2)
一口あたりの価格	29,962円(2021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（2021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（注）
価 格	0円（2021年4月30日現在）

注：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（注）
13,782,520,000円

注：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2020年5月1日至2021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）
—	—	900,000	12,225,970

#### 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。

カストディ業務については、ルクセンブルク三菱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（2021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	13,782,520
固定資産合計	13,782,520
資産合計	13,782,520
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	6,248,829
元本合計	6,248,829
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	7,533,690
評価・換算差額等合計	7,533,690
元本等合計	13,782,520
負債・元本等合計	13,782,520

<損益計算書（注1）（注2）>

当計算期間（自 2020年5月1日 至 2021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	—
当期未処分利益	—
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）
2020年5月29日	17,568
2020年6月30日	17,948
2020年7月31日	18,727
2020年8月31日	21,630
2020年9月30日	20,557
2020年10月30日	18,634
2020年11月30日	23,186
2020年12月30日	24,337
2021年1月29日	23,575
2021年2月26日	25,040
2021年3月31日	28,472
2021年4月30日	29,962

## 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 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 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。
2021 年 4 月 30 日現在	
2020 年 5 月 1 日～2021 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	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	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	1,200,000 口 (2021 年 4 月 30 日時点)
価格	3,667,200,000 円 (2021 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	3,056 円 (2021 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 (2021 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（注）
価 格	0円（2021年4月30日現在）

注：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（注）
3,667,200,000円

注：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2020年5月1日 至2021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	765,200	—	—

#### 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、ルクセンブルク三菱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（2021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	3,667,200
固定資産合計	3,667,200
資産合計	3,667,200
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	8,205,540
元本合計	8,205,540
留保金	
次期繰越損失（△）	△4,538,340
留保金合計	△4,538,340

評価・換算差額等	—
評価・換算差額等合計	
元本等合計	3,667,200
負債・元本等合計	3,667,200

<損益計算書（注1）>

当計算期間（自 2020年5月1日 至 2021年4月30日）

（単位：千円）

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	4,538,340
当期純損失（△）	△4,538,340
前期繰越損失（△）	—
当期未処理損失（△）	△4,538,340
次期繰越損失（△）	△4,538,340

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）
2020年5月29日	4,299
2020年6月30日	4,178
2020年7月31日	4,069
2020年8月31日	3,764
2020年9月30日	3,831
2020年10月30日	3,997
2020年11月30日	3,550
2020年12月30日	3,454
2021年1月29日	3,494
2021年2月26日	3,372
2021年3月31日	3,145
2021年4月30日	3,056

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  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。
第 8 期	
2021 年 4 月 30 日現在	
2020 年 5 月 1 日～2021 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	東証マザーズ指数連動債
数量	500,000 口（2021 年 4 月 30 日時点）
価格	6,485,500,000 円（2021 年 4 月 30 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	12,971 円（2021 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（2021 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（注）
価 格	0 円（2021 年 4 月 30 日現在）

注：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（注）
6,485,500,000 円

注：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 2020 年 5 月 1 日 至 2021 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）
—	—	700,000	6,985,433

#### 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、ルクセンブルク三菱 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（2021 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	6,485,500
固定資産合計	6,485,500
資産合計	6,485,500
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	4,989,596
元本合計	4,989,596
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	1,495,903
評価・換算差額等合計	1,495,903

元本等合計	6,485,500
負債・元本等合計	6,485,500

<損益計算書（注1）（注2）>

当計算期間（自 2020年5月1日 至 2021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	—
当期未処分利益	—
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）
2020年5月29日	10,653
2020年6月30日	10,970
2020年7月31日	10,381
2020年8月31日	12,146
2020年9月30日	13,277
2020年10月30日	12,673
2020年11月30日	13,329
2020年12月30日	12,936
2021年1月29日	13,065
2021年2月26日	13,115
2021年3月31日	12,993
2021年4月30日	12,971

## 掲載番号13

### 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 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。
2021 年 4 月 30 日現在	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。
2020 年 5 月 1 日～2021 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 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 (2021 年 4 月 30 日時点)
価格	2,172,960,000 円 (2021 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	13,581 円 (2021 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（2021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（注）
価 格	0円（2021年4月30日現在）

注：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（注）
2,172,960,000円

注：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2020年5月1日 至2021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、ルクセンブルク三菱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（2021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	2,172,960
固定資産合計	2,172,960
資産合計	2,172,960
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	455,260
評価・換算差額等合計	455,260
元本等合計	2,172,960
負債・元本等合計	2,172,960

<損益計算書（注1）（注2）>

当計算期間（自 2020年5月1日 至 2021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	—
当期未処分利益	—
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）
2020年5月29日	9,667
2020年6月30日	10,264
2020年7月31日	10,015
2020年8月31日	10,126
2020年9月30日	9,384
2020年10月30日	9,409
2020年11月30日	11,357
2020年12月30日	11,862
2021年1月29日	11,806
2021年2月26日	12,464
2021年3月31日	13,281
2021年4月30日	13,581

## 掲載番号14

### 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
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。
2021 年 4 月 30 日現在	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。
2020 年 5 月 1 日～2021 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 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&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（2021 年 4 月 30 日時点）
価格	36,570,000,000 円（2021 年 4 月 30 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	18,285 円（2021 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（2021 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（注）
価 格	0円（2021年4月30日現在）

注：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（注）
36,570,000,000円

注：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2020年5月1日 至2021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、ルクセンブルク三菱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（2021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		36,570,000
固定資産合計		36,570,000
資産合計		36,570,000
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		16,093,600

評価・換算差額等合計	16,093,600
元本等合計	36,570,000
負債・元本等合計	36,570,000

<損益計算書（注1）（注2）>

当計算期間（自 2020年5月1日 至 2021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	—
当期未処分利益	—
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）
2020年5月29日	13,265
2020年6月30日	13,423
2020年7月31日	13,811
2020年8月31日	14,389
2020年9月30日	14,099
2020年10月30日	13,682
2020年11月30日	15,259
2020年12月30日	15,215
2021年1月29日	15,234
2021年2月26日	15,916
2021年3月31日	17,726
2021年4月30日	18,285

## 掲載番号15

### 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 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。
2021 年 4 月 30 日現在	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。
2020 年 5 月 1 日～2021 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 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 (2021 年 4 月 30 日時点)
価格	2,755,400,000 円 (2021 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	13,777 円 (2021 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 (2021 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（注）
価 格	0円（2021年4月30日現在）

注：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（注）
2,755,400,000円

注：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2020年5月1日 至2021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、ルクセンブルク三菱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（2021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	2,755,400
固定資産合計	2,755,400
資産合計	2,755,400
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	735,600
評価・換算差額等合計	735,600
元本等合計	2,755,400
負債・元本等合計	2,755,400

<損益計算書（注1）（注2）>

当計算期間（自 2020年5月1日 至 2021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	—
当期未処分利益	—
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）
2020年5月29日	11,682
2020年6月30日	11,765
2020年7月31日	12,198
2020年8月31日	12,314
2020年9月30日	12,152
2020年10月30日	11,176
2020年11月30日	12,232
2020年12月30日	12,654
2021年1月29日	12,957
2021年2月26日	12,698
2021年3月31日	13,535
2021年4月30日	13,777

## 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 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 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。
2021 年 4 月 30 日現在	
2020 年 5 月 1 日～2021 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、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	Nifty レバレッジ(プライスリターン) 指数連動債
数量	360,000 口 (2021 年 4 月 30 日時点)
価格	4,569,120,000 円 (2021 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	12,692 円 (2021 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 (2021 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（注）
価 格	0円（2021年4月30日現在）

注：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（注）
4,569,120,000円

注：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2020年5月1日 至2021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、ルクセンブルク三菱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（2021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	4,569,120
固定資産合計	4,569,120
資産合計	4,569,120
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	1,013,820

評価・換算差額等合計	1,013,820
元本等合計	4,569,120
負債・元本等合計	4,569,120

<損益計算書（注1）（注2）>

当計算期間（自 2020年5月1日 至 2021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	—
当期未処分利益	—
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）
2020年5月29日	5,624
2020年6月30日	6,477
2020年7月31日	7,360
2020年8月31日	7,893
2020年9月30日	7,595
2020年10月30日	7,984
2020年11月30日	9,838
2020年12月30日	11,374
2021年1月29日	10,961
2021年2月26日	12,465
2021年3月31日	13,193
2021年4月30日	12,692

## 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 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 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。
2021 年 4 月 30 日現在	
2020 年 5 月 1 日～2021 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	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 (2021 年 4 月 30 日時点)
価格	278,640,000 円 (2021 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	4,644 円 (2021 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 (2021 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（注）
価 格	0円（2021年4月30日現在）

注：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（注）
278,640,000円

注：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2020年5月1日至2021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、ルクセンブルク三菱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（2021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	278,640
固定資産合計	278,640
資産合計	278,640
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	
次期繰越損失（△）	△321,360
留保金合計	△321,360
評価・換算差額等	

評価・換算差額等合計	—
元本等合計	278,640
負債・元本等合計	278,640

<損益計算書（注1）>

当計算期間（自 2020年5月1日 至 2021年4月30日）

（単位：千円）

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	321,360
当期純損失（△）	△321,360
前期繰越損失（△）	—
当期未処理損失（△）	△321,360
次期繰越損失（△）	△321,360

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）
2020年5月29日	6,970
2020年6月30日	6,488
2020年7月31日	5,958
2020年8月31日	5,898
2020年9月30日	5,921
2020年10月30日	5,632
2020年11月30日	5,043
2020年12月30日	4,679
2021年1月29日	4,887
2021年2月26日	4,609
2021年3月31日	4,745
2021年4月30日	4,644

## 掲載番号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 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。
2021 年 4 月 30 日現在	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。
2020 年 5 月 1 日～2021 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 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	300,000 口 (2021 年 4 月 30 日時点)
価格	3,223,200,000 円 (2021 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	10,744 円 (2021 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（2021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（注）
価 格	0円（2021年4月30日現在）

注：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（注）
3,223,200,000円

注：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2020年5月1日至2021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）
—	—	300,000	2,910,881

#### 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、ルクセンブルク三菱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（2021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	3,223,200
固定資産合計	3,223,200
資産合計	3,223,200
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	2,910,881
元本合計	2,910,881
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	312,318
評価・換算差額等合計	312,318
元本等合計	3,223,200
負債・元本等合計	3,223,200

<損益計算書（注1）（注2）>

当計算期間（自 2020年5月1日 至 2021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	—
当期未処分利益	—
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）
2020年5月29日	8,665
2020年6月30日	8,429
2020年7月31日	7,658
2020年8月31日	8,562
2020年9月30日	8,391
2020年10月30日	8,006
2020年11月30日	8,662
2020年12月30日	8,860
2021年1月29日	9,259
2021年2月26日	10,016
2021年3月31日	11,288
2021年4月30日	10,744

## 掲載番号19

### 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
第 2 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。
2021 年 4 月 30 日現在	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。
2020 年 5 月 1 日～2021 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 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	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	60,000 口（2021 年 4 月 30 日時点）
価格	738,540,000 円（2021 年 4 月 30 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	12,309 円（2021 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（2021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（注）
価 格	0円（2021年4月30日現在）

注：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（注）
738,540,000円

注：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2020年5月1日至2021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）
—	—	140,000	1,394,414

#### 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。

カストディ業務については、ルクセンブルク三菱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（2021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	738,540
固定資産合計	738,540
資産合計	738,540
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	597,606
元本合計	597,606
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	140,934
評価・換算差額等合計	140,934
元本等合計	738,540
負債・元本等合計	738,540

<損益計算書（注1）（注2）>

当計算期間（自 2020年5月1日 至 2021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	—
当期未処分利益	—
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）
2020年5月29日	9,772
2020年6月30日	9,592
2020年7月31日	9,072
2020年8月31日	9,766
2020年9月30日	10,092
2020年10月30日	9,838
2020年11月30日	10,460
2020年12月30日	10,912
2021年1月29日	11,059
2021年2月26日	11,491
2021年3月31日	12,473
2021年4月30日	12,309

## 掲載番号20

### 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 5 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。
2021 年 4 月 30 日現在	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。
2020 年 5 月 1 日～2021 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 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/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/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（2021 年 4 月 30 日時点）
価格	2,573,800,000 円（2021 年 4 月 30 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	12,869 円（2021 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（2021 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（注）
価 格	0円（2021年4月30日現在）

注：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（注）
2,573,800,000円

注：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2020年5月1日至2021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、ルクセンブルク三菱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（2021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	2,573,800
固定資産合計	2,573,800
資産合計	2,573,800
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	573,800

評価・換算差額等合計	573,800
元本等合計	2,573,800
負債・元本等合計	2,573,800

<損益計算書（注1）（注2）>

当計算期間（自 2020年5月1日 至 2021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	—
当期未処分利益	—
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）
2020年5月29日	10,349
2020年6月30日	10,113
2020年7月31日	9,224
2020年8月31日	10,289
2020年9月30日	10,271
2020年10月30日	9,940
2020年11月30日	10,565
2020年12月30日	10,816
2021年1月29日	11,217
2021年2月26日	12,060
2021年3月31日	13,634
2021年4月30日	12,869

## 掲載番号21

### 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 5 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。
2021 年 4 月 30 日現在	
2020 年 5 月 1 日～2021 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、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	100,000 口 (2021 年 4 月 30 日時点)
価格	1,364,600,000 円 (2021 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	13,646 円 (2021 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 (2021 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（注）
価 格	0円（2021年4月30日現在）

注：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（注）
1,364,600,000円

注：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2020年5月1日 至2021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	1,954,866

#### 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、ルクセンブルク三菱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（2021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	1,364,600
固定資産合計	1,364,600
資産合計	1,364,600
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	977,433
元本合計	977,433
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	387,166
評価・換算差額等合計	387,166
元本等合計	1,364,600
負債・元本等合計	1,364,600

<損益計算書（注1）（注2）> 当計算期間（自 2020年5月1日 至 2021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	—
当期未処分利益	—
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）
2020年5月29日	10,796
2020年6月30日	10,621
2020年7月31日	10,427
2020年8月31日	11,033
2020年9月30日	10,866
2020年10月30日	10,208
2020年11月30日	10,531
2020年12月30日	11,056
2021年1月29日	11,629
2021年2月26日	12,405
2021年3月31日	13,435
2021年4月30日	13,646

## 掲載番号22

# 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 5 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。
2021 年 4 月 30 日現在	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。
2020 年 5 月 1 日～2021 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 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	300,000 口 (2021 年 4 月 30 日時点)
価格	3,771,300,000 円 (2021 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	12,571 円 (2021 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 (2021 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（注）
価 格	0円（2021年4月30日現在）

注：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（注）
3,771,300,000円

注：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2020年5月1日 至2021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）
—	—	300,000	3,411,049

#### 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、ルクセンブルク三菱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（2021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	3,771,300
固定資産合計	3,771,300
資産合計	3,771,300
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	3,411,050
元本合計	3,411,050
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	360,249
評価・換算差額等合計	360,249
元本等合計	3,771,300
負債・元本等合計	3,771,300

<損益計算書（注1）（注2）> 当計算期間（自 2020年5月1日 至 2021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	—
当期未処分利益	—
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）
2020年5月29日	9,433
2020年6月30日	9,424
2020年7月31日	9,053
2020年8月31日	9,875
2020年9月30日	9,825
2020年10月30日	9,497
2020年11月30日	10,484
2020年12月30日	10,896
2021年1月29日	11,327
2021年2月26日	11,962
2021年3月31日	12,900
2021年4月30日	12,571

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 5 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。
2021 年 4 月 30 日現在	
2020 年 5 月 1 日～2021 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	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。
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	野村日本株高ベータ・セレクト 30(ネットリターン)連動債
数量	100,000 口 (2021 年 4 月 30 日時点)
価格	1,357,300,000 円 (2021 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	13,573 円 (2021 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（2021 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（注）
価 格	0円（2021年4月30日現在）

注：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（注）
1,357,300,000円

注：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2020年5月1日至2021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	1,047,500

#### 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。

カスタディー業務については、ルクセンブルク三菱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（2021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	1,357,300
固定資産合計	1,357,300
資産合計	1,357,300
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	1,047,500
元本合計	1,047,500
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	309,800

評価・換算差額等合計	309,800
元本等合計	1,357,300
負債・元本等合計	1,357,300

<損益計算書（注1）（注2）>

当計算期間（自 2020年5月1日 至 2021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	—
当期未処分利益	—
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）
2020年5月29日	9,007
2020年6月30日	9,457
2020年7月31日	9,391
2020年8月31日	9,799
2020年9月30日	10,042
2020年10月30日	10,106
2020年11月30日	11,746
2020年12月30日	12,050
2021年1月29日	12,548
2021年2月26日	12,952
2021年3月31日	13,492
2021年4月30日	13,573

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 5 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。
2021 年 4 月 30 日現在	
2020 年 5 月 1 日～2021 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	100,000 口 (2021 年 4 月 30 日時点)
価格	1,223,000,000 円 (2021 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	12,230 円 (2021 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 (2021 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（注）
価 格	0円（2021年4月30日現在）

注：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（注）
1,223,000,000円

注：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2020年5月1日至2021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	1,033,100

#### 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、ルクセンブルク三菱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（2021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	1,223,000
固定資産合計	1,223,000
資産合計	1,223,000
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	1,033,100
元本合計	1,033,100
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	189,900

評価・換算差額等合計	189,900
元本等合計	1,223,000
負債・元本等合計	1,223,000

<損益計算書（注1）（注2）>

当計算期間（自 2020年5月1日 至 2021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	—
当期未処分利益	—
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）
2020年5月29日	11,518
2020年6月30日	11,197
2020年7月31日	10,293
2020年8月31日	10,999
2020年9月30日	10,876
2020年10月30日	10,565
2020年11月30日	11,452
2020年12月30日	11,619
2021年1月29日	11,744
2021年2月26日	11,985
2021年3月31日	12,653
2021年4月30日	12,230