

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 : 2 0 3 1 4 )  
 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  
 松 成 寿 和 03-3211-1811

## 2023年4月期(2022年5月1日~2023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 金先物 ダブル・ブル ETN</a>	2036	東
6	<a href="#">NEXT NOTES 金先物 ベア ETN</a>	2037	東
7	<a href="#">NEXT NOTES ドバイ原油先物 ダブル・ブル ETN</a>	2038	東
8	<a href="#">NEXT NOTES ドバイ原油先物 ベア ETN</a>	2039	東
9	<a href="#">NEXT NOTES NY ダウ・ダブル・ブル・ドルヘッジ ETN</a>	2040	東
10	<a href="#">NEXT NOTES NY ダウ・ベア・ドルヘッジ ETN</a>	2041	東
11	<a href="#">NEXT NOTES 東証マザーズ ETN</a>	2042	東
12	<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
13	<a href="#">NEXT NOTES S&amp;P500 配当貴族 (ネットリターン) ETN</a>	2044	東
14	<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
15	<a href="#">NEXT NOTES インド Nifty・ダブル・ブル ETN</a>	2046	東
16	<a href="#">NEXT NOTES インド Nifty・ベア ETN</a>	2047	東
17	<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
18	<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
19	<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
20	<a href="#">NEXT NOTES 東証 REIT (ドルヘッジ、ネットリターン) ETN</a>	2066	東
21	<a href="#">NEXT NOTES 野村 AI ビジネス 70 (ネットリターン) ETN</a>	2067	東
22	<a href="#">NEXT NOTES 高ベータ 30 (ネットリターン) ETN</a>	2068	東
23	<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

# 2031 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 11 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・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。
2023 年 4 月 30 日現在	
2022 年 5 月 1 日～2023 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・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一時的に受領する金銭その他の財産により構成されますが、原則的に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	ハンセン指数・レバレッジインデックス連動債
数量	700,000 口（2023 年 4 月 30 日時点）
価格	4,086,600,000 円（2023 年 4 月 30 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	5,838 円（2023 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（2023 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（2023 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）
4,086,600,000 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、NEXT NOTESウェブサイトをご覧ください。

### ■取引の状況（自 2022 年 5 月 1 日 至 2023 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）
600,000	2,618,200	—	—

#### 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（2023 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	4,086,600
固定資産合計	4,086,600
資産合計	4,086,600
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	3,850,469
元本合計	3,850,469
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	236,130

評価・換算差額等合計	236,130
元本等合計	4,086,600
負債・元本等合計	4,086,600

< 損益計算書（注1）（注2） >      当計算期間（自 2022年5月1日 至 2023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	—
利益処分別	—
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）
2022年5月31日	7,076
2022年6月30日	7,726
2022年7月29日	6,426
2022年8月31日	6,492
2022年9月30日	5,015
2022年10月31日	3,685
2022年11月30日	5,452
2022年12月30日	5,775
2023年1月31日	6,865
2023年2月28日	5,863
2023年3月31日	6,023
2023年4月28日	5,838

## 掲載番号 2

# 2032 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 11 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。
2023 年 4 月 30 日現在	
2022 年 5 月 1 日～2023 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一時的に受領する金銭その他の財産により構成されますが、原則的に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・ショートインデックス連動債
数量	60,000 口（2023 年 4 月 30 日時点）
価格	457,920,000 円（2023 年 4 月 30 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	7,632 円（2023 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（2023 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（2023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）
457,920,000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、NEXT NOTESウェブサイトをご覧ください。

### ■取引の状況（自2022年5月1日至2023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（2023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	457,920
固定資産合計	457,920
資産合計	457,920
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	△142,080

評価・換算差額等合計	△142,080
元本等合計	457,920
負債・元本等合計	457,920

< 損益計算書（注1）（注2） > 当計算期間（自 2022年5月1日 至 2023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	—
利益処分別	—
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）
2022年5月31日	7,326
2022年6月30日	7,457
2022年7月29日	7,881
2022年8月31日	8,212
2022年9月30日	9,836
2022年10月31日	11,713
2022年11月30日	8,564
2022年12月30日	7,579
2023年1月31日	6,722
2023年2月28日	7,750
2023年3月31日	7,273
2023年4月28日	7,632

## 掲載番号 3

# 2033 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 11 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。
2023 年 4 月 30 日現在	
2022 年 5 月 1 日～2023 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一時的に受領する金銭その他の財産により構成されますが、原則的に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	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（2023 年 4 月 30 日時点）
価格	650,040,000 円（2023 年 4 月 30 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	10,834 円（2023 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（2023 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（2023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）
650,040,000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、NEXT NOTESウェブサイトをご覧ください。

### ■取引の状況（自2022年5月1日至2023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（2023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		650,040
固定資産合計		650,040
資産合計		650,040
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		50,040

評価・換算差額等合計	50,040
元本等合計	650,040
負債・元本等合計	650,040

< 損益計算書（注1）（注2） > 当計算期間（自 2022年5月1日 至 2023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	—
利益処分別	—
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）
2022年5月31日	13,987
2022年6月30日	10,488
2022年7月29日	11,367
2022年8月31日	11,367
2022年9月30日	8,362
2022年10月31日	9,711
2022年11月30日	11,221
2022年12月30日	9,041
2023年1月31日	10,790
2023年2月28日	10,298
2023年3月31日	10,641
2023年4月28日	10,834

**掲載番号 4****2034 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 11 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。
2023 年 4 月 30 日現在	
2022 年 5 月 1 日～2023 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	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一時的に受領する金銭その他の財産により構成されますが、原則的に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	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	200,000 口 (2023 年 4 月 30 日時点)
価格	1,530,200,000 円 (2023 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	7,651 円 (2023 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 (2023 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（2023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）
1,530,200,000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、NEXT NOTESウェブサイトをご覧ください。

### ■取引の状況（自2022年5月1日至2023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（2023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		1,530,200
固定資産合計		1,530,200
資産合計		1,530,200
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		1,867,480
元本合計		1,867,480
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		△337,280

評価・換算差額等合計	△337,280
元本等合計	1,530,200
負債・元本等合計	1,530,200

< 損益計算書（注1）（注2） >      当計算期間（自 2022年5月1日 至 2023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	—
利益処分別	—
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）
2022年5月31日	7,295
2022年6月30日	8,420
2022年7月29日	7,859
2022年8月31日	7,972
2022年9月30日	8,835
2022年10月31日	8,544
2022年11月30日	8,138
2022年12月30日	8,710
2023年1月31日	8,096
2023年2月28日	7,957
2023年3月31日	7,747
2023年4月28日	7,651

## 掲載番号 5

# 2036 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
第 11 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 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。
2023 年 4 月 30 日現在	
2022 年 5 月 1 日～2023 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一時的に受領する金銭その他の財産により構成されますが、原則的に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	日経・JPX 金レバレッジ指数連動債（注 1）
数量	250,000 口（2023 年 4 月 30 日時点）
価格	7,811,000,000 円（2023 年 4 月 30 日時点）（注 2）（注 3）
一口あたりの価格	31,244 円（2023 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（2023 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（2023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）
7,811,000,000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、NEXT NOTESウェブサイトをご覧ください。

### ■取引の状況（自2022年5月1日至2023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（2023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	7,811,000
固定資産合計	7,811,000
資産合計	7,811,000
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	5,548,440

評価・換算差額等合計	5,548,440
元本等合計	7,811,000
負債・元本等合計	7,811,000

< 損益計算書（注1）（注2） >      当計算期間（自 2022年5月1日 至 2023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	—
利益処分別	—
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）
2022年5月31日	24,722
2022年6月30日	26,915
2022年7月29日	24,214
2022年8月31日	24,986
2022年9月30日	25,461
2022年10月31日	25,778
2022年11月30日	25,882
2022年12月30日	25,495
2023年1月31日	27,117
2023年2月28日	26,693
2023年3月31日	30,112
2023年4月28日	31,244



## 掲載番号 6

# 2037 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
第 11 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 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。
2023 年 4 月 30 日現在	
2022 年 5 月 1 日～2023 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一時的に受領する金銭その他の財産により構成されますが、原則的に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 金インバース指数連動債（注 1）
数量	100,000 口（2023 年 4 月 30 日時点）
価格	392,500,000 円（2023 年 4 月 30 日時点）（注 2）（注 3）
一口あたりの価格	3,925 円（2023 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（2023 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（2023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）
392,500,000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、NEXT NOTESウェブサイトをご覧ください。

### ■取引の状況（自2022年5月1日至2023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（2023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	392,500
固定資産合計	392,500
資産合計	392,500
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	
次期繰越損失（△）	△458,740
留保金合計	△458,740
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	—

評価・換算差額等合計	—
元本等合計	392,500
負債・元本等合計	392,500

< 損益計算書（注） >

当計算期間（自 2022 年 5 月 1 日 至 2023 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	458,740
当期純損失（△）	△458,740
前期繰越損失（△）	—
当期末処理損失（△）	△458,740
次期繰越損失（△）	△458,740

注：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）
2022 年 5 月 31 日	4,553
2022 年 6 月 30 日	4,350
2022 年 7 月 29 日	4,566
2022 年 8 月 31 日	4,485
2022 年 9 月 30 日	4,428
2022 年 10 月 31 日	4,387
2022 年 11 月 30 日	4,367
2022 年 12 月 30 日	4,389
2023 年 1 月 31 日	4,244
2023 年 2 月 28 日	4,270
2023 年 3 月 31 日	4,006
2023 年 4 月 28 日	3,925

## 掲載番号 7

# 2038 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 11 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。
2023 年 4 月 30 日現在	
2022 年 5 月 1 日～2023 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	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一時的に受領する金銭その他の財産により構成されますが、原則的に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 原油レバレッジ指数連動債（注 1）
数量	65,000,000 口（2023 年 4 月 30 日時点）
価格	81,445,000,000 円（2023 年 4 月 30 日時点）（注 2）（注 3）
一口あたりの価格	1,253 円（2023 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（2023 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（2023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）
81,445,000,000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、NEXT NOTESウェブサイトをご覧ください。

### ■取引の状況（自2022年5月1日至2023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）
15,000,000	19,965,000	45,000,000	14,245,595

#### 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（2023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		81,445,000
固定資産合計		81,445,000
資産合計		81,445,000
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		35,793,439
元本合計		35,793,439
留保金		
次期繰越損失（△）		△7,698,593
留保金合計		△7,698,593
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		53,350,154
評価・換算差額等合計		53,350,154

元本等合計	81,445,000
負債・元本等合計	81,445,000

< 損益計算書（注1）（注2） > 当計算期間（自 2022年5月1日 至 2023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	—
当期純利益	—
前期繰越損失（△）	△14,627,328
当期一部解約に伴う前期繰越損失の減少額	6,928,735
当期末処理損失（△）	△7,698,593
次期繰越損失（△）	△7,698,593

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）
2022年5月31日	1,890
2022年6月30日	1,891
2022年7月29日	1,580
2022年8月31日	1,672
2022年9月30日	1,424
2022年10月31日	1,695
2022年11月30日	1,364
2022年12月30日	1,206
2023年1月31日	1,211
2023年2月28日	1,315
2023年3月31日	1,179
2023年4月28日	1,253

2039 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
第 11 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 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。
2023 年 4 月 30 日現在	
2022 年 5 月 1 日～2023 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一時的に受領する金銭その他の財産により構成されますが、原則的に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 原油インバース指数連動債（注 1）
数量	9,500,000 口（2023 年 4 月 30 日時点）
価格	13,537,500,000 円（2023 年 4 月 30 日時点）（注 2）（注 3）
一口あたりの価格	1,425 円（2023 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（2023 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（2023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）
13,537,500,000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、NEXT NOTESウェブサイトをご覧ください。

### ■取引の状況（自2022年5月1日至2023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（2023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	13,537,500
固定資産合計	13,537,500
資産合計	13,537,500
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	23,539,828
元本合計	23,539,828
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	
その他有価証券評価差額金	△6,754,100



評価・換算差額等合計	△6,754,100
元本等合計	13,537,500
負債・元本等合計	13,537,500

< 損益計算書（注1）（注2） > 当計算期間（自 2022年5月1日 至 2023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	—
当期純利益	—
前期繰越損失（△）	△3,248,228
当期末処理損失（△）	△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。

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）
2022年5月31日	1,425
2022年6月30日	1,397
2022年7月29日	1,452
2022年8月31日	1,388
2022年9月30日	1,480
2022年10月31日	1,345
2022年11月30日	1,472
2022年12月30日	1,545
2023年1月31日	1,517
2023年2月28日	1,444
2023年3月31日	1,493
2023年4月28日	1,425

## 掲載番号 9

### 2040 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 10 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。
2023 年 4 月 30 日現在	
2022 年 5 月 1 日～2023 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一時的に受領する金銭その他の財産により構成されますが、原則的に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	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 (2023 年 4 月 30 日時点)
価格	11,650,420,000 円 (2023 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	25,327 円 (2023 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（2023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（2023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）
11,650,420,000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、NEXT NOTESウェブサイトをご覧ください。

■取引の状況（自2022年5月1日至2023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（2023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		11,650,420
固定資産合計		11,650,420
資産合計		11,650,420
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	5,401,590
評価・換算差額等合計	5,401,590
元本等合計	11,650,420
負債・元本等合計	11,650,420

< 損益計算書（注1）（注2） >                      当計算期間（自 2022年5月1日 至 2023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	—
利益処分別	—
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）
2022年5月31日	27,045
2022年6月30日	23,094
2022年7月29日	26,091
2022年8月31日	23,775
2022年9月30日	19,370
2022年10月31日	25,017
2022年11月30日	27,508
2022年12月30日	25,052
2023年1月31日	26,189
2023年2月28日	23,739
2023年3月31日	24,345
2023年4月28日	25,327

## 掲載番号10

# 2041 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 10 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。
2023 年 4 月 30 日現在	
2022 年 5 月 1 日～2023 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一時的に受領する金銭その他の財産により構成されますが、原則的に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	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	2,500,000 口 (2023 年 4 月 30 日時点)
価格	7,170,000,000 円 (2023 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	2,868 円 (2023 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 (2023 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（2023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）
7,170,000,000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、NEXT NOTESウェブサイトをご覧ください。

■取引の状況（自2022年5月1日至2023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	2,665,500	—	—

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（2023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		7,170,000
固定資産合計		7,170,000
資産合計		7,170,000
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		12,045,440
元本合計		12,045,440
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		

その他有価証券評価差額金	△337,100
評価・換算差額等合計	△337,100
元本等合計	7,170,000
負債・元本等合計	7,170,000

<損益計算書(注1)(注2)> 当計算期間(自2022年5月1日至2023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	—
当期純利益	—
前期繰越損失(△)	△4,538,340
当期末処理損失(△)	△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。

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)
2022年5月31日	2,988
2022年6月30日	3,201
2022年7月29日	2,997
2022年8月31日	3,113
2022年9月30日	3,420
2022年10月31日	2,980
2022年11月30日	2,816
2022年12月30日	2,938
2023年1月31日	2,861
2023年2月28日	2,989
2023年3月31日	2,934
2023年4月28日	2,868

## 掲載番号11

# 2042 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 10 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。
2023 年 4 月 30 日現在	
2022 年 5 月 1 日～2023 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一時的に受領する金銭その他の財産により構成されますが、原則的に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	東証マザーズ指数連動債
数量	500,000 口（2023 年 4 月 30 日時点）
価格	3,982,000,000 円（2023 年 4 月 30 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	7,964 円（2023 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（2023 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（2023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）
3,982,000,000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、NEXT NOTESウェブサイトをご覧ください。

### ■取引の状況（自2022年5月1日至2023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（2023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	3,982,000
固定資産合計	3,982,000
資産合計	3,982,000
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	△1,007,596

評価・換算差額等合計	△1,007,596
元本等合計	3,982,000
負債・元本等合計	3,982,000

< 損益計算書（注1）（注2） >                      当計算期間（自 2022年5月1日 至 2023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	—
利益処分別	—
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）
2022年5月31日	7,206
2022年6月30日	7,099
2022年7月29日	7,708
2022年8月31日	7,957
2022年9月30日	7,452
2022年10月31日	7,987
2022年11月30日	8,497
2022年12月30日	7,818
2023年1月31日	8,302
2023年2月28日	8,007
2023年3月31日	8,012
2023年4月28日	7,964

## 掲載番号12

### 2043 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 10 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。
2023 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。
2022 年 5 月 1 日～2023 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一時的に受領する金銭その他の財産により構成されますが、原則的に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	60,000 口 (2023 年 4 月 30 日時点)
価格	1,001,460,000 円 (2023 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	16,691 円 (2023 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 (2023 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（2023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）
1,001,460,000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、NEXT NOTESウェブサイトをご覧ください。

### ■取引の状況（自2022年5月1日至2023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（2023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		1,001,460
固定資産合計		1,001,460
資産合計		1,001,460
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		644,137
元本合計		644,137
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		357,322

評価・換算差額等合計	357,322
元本等合計	1,001,460
負債・元本等合計	1,001,460

< 損益計算書（注1）（注2） > 当計算期間（自 2022年5月1日 至 2023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	—
利益処分別	—
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）
2022年5月31日	15,815
2022年6月30日	15,222
2022年7月29日	15,264
2022年8月31日	16,418
2022年9月30日	15,957
2022年10月31日	16,879
2022年11月30日	16,864
2022年12月30日	15,971
2023年1月31日	16,381
2023年2月28日	16,150
2023年3月31日	16,253
2023年4月28日	16,691

## 掲載番号13

### 2044 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 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 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。
2023 年 4 月 30 日現在	
2022 年 5 月 1 日～2023 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一時的に受領する金銭その他の財産により構成されますが、原則的に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&P500 配当貴族指数（課税後配当込み）連動債
数量	1,000,000 口（2023 年 4 月 30 日時点）
価格	23,947,000,000 円（2023 年 4 月 30 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	23,947 円（2023 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（2023 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（2023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）
23,947,000,000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、NEXT NOTESウェブサイトをご覧ください。

### ■取引の状況（自2022年5月1日至2023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）
—	—	1,000,000	10,238,200

#### 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（2023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		23,947,000
固定資産合計		23,947,000
資産合計		23,947,000
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		10,238,200
元本合計		10,238,200
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	13,708,800
評価・換算差額等合計	13,708,800
元本等合計	23,947,000
負債・元本等合計	23,947,000

< 損益計算書（注1）（注2） >                      当計算期間（自 2022年5月1日 至 2023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	—
利益処分別	—
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）
2022年5月31日	22,150
2022年6月30日	21,776
2022年7月29日	22,826
2022年8月31日	22,990
2022年9月30日	21,757
2022年10月31日	24,656
2022年11月30日	24,772
2022年12月30日	22,425
2023年1月31日	22,793
2023年2月28日	23,295
2023年3月31日	22,937
2023年4月28日	23,947



## 掲載番号14

### 2045 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 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。
2023 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。
2022 年 5 月 1 日～2023 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一時的に受領する金銭その他の財産により構成されますが、原則的に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	50,000 口 (2023 年 4 月 30 日時点)
価格	793,750,000 円 (2023 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	15,875 円 (2023 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 (2023 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（2023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）
793,750,000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、NEXT NOTESウェブサイトをご覧ください。

### ■取引の状況（自2022年5月1日至2023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（2023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	793,750
固定資産合計	793,750
資産合計	793,750
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	504,950
元本合計	504,950
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	288,800

評価・換算差額等合計	288,800
元本等合計	793,750
負債・元本等合計	793,750

< 損益計算書（注1）（注2） > 当計算期間（自 2022年5月1日 至 2023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	—
利益処分別	—
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）
2022年5月31日	15,368
2022年6月30日	15,869
2022年7月29日	16,174
2022年8月31日	16,114
2022年9月30日	15,154
2022年10月31日	14,903
2022年11月30日	15,304
2022年12月30日	14,618
2023年1月31日	15,675
2023年2月28日	15,674
2023年3月31日	15,470
2023年4月28日	15,875

## 掲載番号15

# 2046 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 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 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。
2023 年 4 月 30 日現在	
2022 年 5 月 1 日～2023 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一時的に受領する金銭その他の財産により構成されますが、原則的に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(2023 年 4 月 30 日時点)
価格	6,752,520,000 円(2023 年 4 月 30 日時点)(注 1)(注 2)
一口あたりの価格	18,757 円(2023 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(2023 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（2023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）
6,752,520,000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、NEXT NOTESウェブサイトをご覧ください。

### ■取引の状況（自2022年5月1日至2023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（2023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		6,752,520
固定資産合計		6,752,520
資産合計		6,752,520
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		3,197,220

評価・換算差額等合計	3,197,220
元本等合計	6,752,520
負債・元本等合計	6,752,520

< 損益計算書（注1）（注2） >      当計算期間（自 2022年5月1日 至 2023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	—
利益処分別	—
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）
2022年5月31日	16,979
2022年6月30日	15,847
2022年7月29日	18,253
2022年8月31日	20,093
2022年9月30日	18,848
2022年10月31日	20,962
2022年11月30日	21,557
2022年12月30日	18,564
2023年1月31日	17,453
2023年2月28日	17,278
2023年3月31日	16,960
2023年4月28日	18,757

**掲載番号16****2047 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 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 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。
2023 年 4 月 30 日現在	
2022 年 5 月 1 日～2023 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 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一時的に受領する金銭その他の財産により構成されますが、原則的に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 (2023 年 4 月 30 日時点)
価格	256,260,000 円 (2023 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	4,271 円 (2023 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 (2023 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（2023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）
256,260,000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、NEXT NOTESウェブサイトをご覧ください。

### ■取引の状況（自2022年5月1日至2023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（2023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	256,260
固定資産合計	256,260
資産合計	256,260
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	
その他有価証券評価差額金	△22,380



評価・換算差額等合計	△22,380
元本等合計	256,260
負債・元本等合計	256,260

< 損益計算書（注1）（注2） > 当計算期間（自 2022年5月1日 至 2023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	—
当期純利益	—
前期繰越損失（△）	△321,360
当期末処理損失（△）	△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。

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）
2022年5月31日	4,530
2022年6月30日	4,938
2022年7月29日	4,452
2022年8月31日	4,451
2022年9月30日	4,726
2022年10月31日	4,534
2022年11月30日	4,167
2022年12月30日	4,031
2023年1月31日	4,127
2023年2月28日	4,385
2023年3月31日	4,311
2023年4月28日	4,271

## 掲載番号17

### 2048 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 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 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。
2023 年 4 月 30 日現在	
2022 年 5 月 1 日～2023 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一時的に受領する金銭その他の財産により構成されますが、原則的に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	200,000 口（2023 年 4 月 30 日時点）
価格	3,487,400,000 円（2023 年 4 月 30 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	17,437 円（2023 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（2023 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（2023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）
3,487,400,000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、NEXT NOTESウェブサイトをご覧ください。

■取引の状況（自2022年5月1日至2023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（2023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	3,487,400
固定資産合計	3,487,400
資産合計	3,487,400
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	1,940,587
元本合計	1,940,587
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	1,546,812
評価・換算差額等合計	1,546,812
元本等合計	3,487,400
負債・元本等合計	3,487,400

<損益計算書（注1）（注2）> 当計算期間（自 2022年5月1日 至 2023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	—
利益処分別	—
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）
2022年5月31日	13,973
2022年6月30日	14,844
2022年7月29日	14,762
2022年8月31日	15,709
2022年9月30日	15,630
2022年10月31日	16,640
2022年11月30日	16,374
2022年12月30日	15,260
2023年1月31日	15,665
2023年2月28日	17,063
2023年3月31日	16,332
2023年4月28日	17,437

## 掲載番号18

### 2050 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 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 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。
2023 年 4 月 30 日現在	
2022 年 5 月 1 日～2023 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一時的に受領する金銭その他の財産により構成されますが、原則的に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	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	20,000 口（2023 年 4 月 30 日時点）
価格	287,000,000 円（2023 年 4 月 30 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	14,350 円（2023 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（2023 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（2023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）
287,000,000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、NEXT NOTESウェブサイトをご覧ください。

### ■取引の状況（自2022年5月1日至2023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（2023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		287,000
固定資産合計		287,000
資産合計		287,000
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		199,202
元本合計		199,202
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	87,798
評価・換算差額等合計	87,798
元本等合計	287,000
負債・元本等合計	287,000

< 損益計算書（注1）（注2） >      当計算期間（自 2022年5月1日 至 2023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	—
利益処分別	—
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）
2022年5月31日	12,351
2022年6月30日	12,237
2022年7月29日	12,740
2022年8月31日	12,992
2022年9月30日	12,424
2022年10月31日	12,673
2022年11月30日	13,118
2022年12月30日	12,755
2023年1月31日	13,202
2023年2月28日	13,686
2023年3月31日	13,948
2023年4月28日	14,350

## 掲載番号19

### 2065 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 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 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。
2023 年 4 月 30 日現在	
2022 年 5 月 1 日～2023 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一時的に受領する金銭その他の財産により構成されますが、原則的に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	50,000 口（2023 年 4 月 30 日時点）
価格	1,028,600,000 円（2023 年 4 月 30 日時点）（注 1）（注 2）
一口あたりの価格	20,572 円（2023 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（2023 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（2023 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, 028, 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、NEXT NOTESウェブサイトをご覧ください。

■取引の状況（自 2022 年 5 月 1 日 至 2023 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（2023 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, 028, 600
固定資産合計		1, 028, 600
資産合計		1, 028, 600
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		500, 000
元本合計		500, 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	528,600
評価・換算差額等合計	528,600
元本等合計	1,028,600
負債・元本等合計	1,028,600

< 損益計算書（注1）（注2） > 当計算期間（自 2022年5月1日 至 2023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	—
利益処分別	—
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）
2022年5月31日	15,871
2022年6月30日	17,221
2022年7月29日	17,178
2022年8月31日	18,063
2022年9月30日	18,475
2022年10月31日	19,413
2022年11月30日	18,967
2022年12月30日	18,023
2023年1月31日	18,351
2023年2月28日	19,834
2023年3月31日	19,076
2023年4月28日	20,572

## 掲載番号20

### 2066 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 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 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。
2023 年 4 月 30 日現在	
2022 年 5 月 1 日～2023 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一時的に受領する金銭その他の財産により構成されますが、原則的に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	30,000 口 (2023 年 4 月 30 日時点)
価格	503,310,000 円 (2023 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	16,777 円 (2023 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 (2023 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（2023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）
503,310,000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、NEXT NOTESウェブサイトをご覧ください。

### ■取引の状況（自2022年5月1日至2023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（2023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		503,310
固定資産合計		503,310
資産合計		503,310
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		293,230
元本合計		293,230
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		210,079

評価・換算差額等合計	210,079
元本等合計	503,310
負債・元本等合計	503,310

< 損益計算書（注1）（注2） > 当計算期間（自 2022年5月1日 至 2023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	—
利益処分別	—
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）
2022年5月31日	16,019
2022年6月30日	16,644
2022年7月29日	16,905
2022年8月31日	17,743
2022年9月30日	17,822
2022年10月31日	18,633
2022年11月30日	17,548
2022年12月30日	16,030
2023年1月31日	15,332
2023年2月28日	16,356
2023年3月31日	15,558
2023年4月28日	16,777

## 掲載番号21

### 2067 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 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 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。
2023 年 4 月 30 日現在	
2022 年 5 月 1 日～2023 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一時的に受領する金銭その他の財産により構成されますが、原則的に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 AI ビジネス 70(ネットリターン)連動債
数量	150,000 口 (2023 年 4 月 30 日時点)
価格	2,166,000,000 円 (2023 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	14,440 円 (2023 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 (2023 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（2023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）
2,166,000,000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、NEXT NOTESウェブサイトをご覧ください。

### ■取引の状況（自2022年5月1日至2023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（2023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		2,166,000
固定資産合計		2,166,000
資産合計		2,166,000
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		1,705,525
元本合計		1,705,525
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	460,474
評価・換算差額等合計	460,474
元本等合計	2,166,000
負債・元本等合計	2,166,000

< 損益計算書（注1）（注2） > 当計算期間（自 2022年5月1日 至 2023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	—
利益処分別	—
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）
2022年5月31日	13,010
2022年6月30日	12,925
2022年7月29日	13,099
2022年8月31日	13,463
2022年9月30日	12,527
2022年10月31日	13,090
2022年11月30日	13,589
2022年12月30日	12,805
2023年1月31日	13,346
2023年2月28日	13,653
2023年3月31日	13,879
2023年4月28日	14,440



## 掲載番号22

# 2068 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 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 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。
2023 年 4 月 30 日現在	
2022 年 5 月 1 日～2023 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一時的に受領する金銭その他の財産により構成されますが、原則的に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	20,000 口 (2023 年 4 月 30 日時点)
価格	332,720,000 円 (2023 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	16,636 円 (2023 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 (2023 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（2023 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）
332,720,000 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、NEXT NOTESウェブサイトをご覧ください。

■取引の状況（自 2022 年 5 月 1 日 至 2023 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（2023 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	332,720
固定資産合計	332,720
資産合計	332,720
負債の部	
負債合計	—
元本等の部	
元本	
受益権	209,500
元本合計	209,500
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	123,220
評価・換算差額等合計	123,220
元本等合計	332,720
負債・元本等合計	332,720

< 損益計算書（注1）（注2） >                      当計算期間（自 2022年5月1日 至 2023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	—
利益処分別	—
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）
2022年5月31日	15,285
2022年6月30日	14,574
2022年7月29日	14,860
2022年8月31日	15,568
2022年9月30日	13,955
2022年10月31日	14,848
2022年11月30日	15,908
2022年12月30日	15,418
2023年1月31日	15,745
2023年2月28日	16,320
2023年3月31日	16,330
2023年4月28日	16,636

## 掲載番号23

# 2069 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 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 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。
2023 年 4 月 30 日現在	
2022 年 5 月 1 日～2023 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一時的に受領する金銭その他の財産により構成されますが、原則的に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	20,000 口 (2023 年 4 月 30 日時点)
価格	290,780,000 円 (2023 年 4 月 30 日時点) (注 1) (注 2)
一口あたりの価格	14,539 円 (2023 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 (2023 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（2023 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）
290,780,000 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、NEXT NOTESウェブサイトをご覧ください。

### ■取引の状況（自 2022 年 5 月 1 日 至 2023 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（2023 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		290,780
固定資産合計		290,780
資産合計		290,780
負債の部		
負債合計		—
元本等の部		
元本		
受益権		206,620
元本合計		206,620
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	84,160
評価・換算差額等合計	84,160
元本等合計	290,780
負債・元本等合計	290,780

< 損益計算書（注1）（注2） > 当計算期間（自 2022年5月1日 至 2023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	—
利益処分別	—
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）
2022年5月31日	13,214
2022年6月30日	13,084
2022年7月29日	13,606
2022年8月31日	13,655
2022年9月30日	13,174
2022年10月31日	13,487
2022年11月30日	13,722
2022年12月30日	13,187
2023年1月31日	13,688
2023年2月28日	13,540
2023年3月31日	13,943
2023年4月28日	14,539