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<br>（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。<br>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。<br>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。 |
| 2026 年 4 月 30 日現在 | |
| 2025 年 5 月 1 日～2026 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す。また、受託者は、受託有価証券をカストディアンを通じて受託者が適切と判断する方法で分別して管理します。 |
| 信託財産の運用 | 受託者は、本信託財産の運用は行いませんが、東京証券取引所において開示される外国指標連動証券の一証券あたりの償還価額は、仕組みとして本指標に連動することが企図されています。 |
| 収益分配方法 | 原則として、信託期間中に分配は行いません。 |

■信託財産を構成する資産の内容

１．ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・ブイ発行の外国指標連動証券（外国債券）

| | |
|---|---|
| 資産の種類 | 外国指標連動証券 |
| 資産の名称 | 税引後配当込東証 REIT 米ドルヘッジ指数連動債 |
| 数量 | 30,000 口（2026 年 4 月 30 日時点） |
| 価格 | 742,290,000 円（2026 年 4 月 30 日時点）（注１）（注２） |
| 一口あたりの価格 | 24,743 円（2026 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（2026 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（2026 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） |
|---|
| 742,290,000 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 2025 年 5 月 1 日 至 2026 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（2026 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 | 742,290 |
| 固定資産合計 | 742,290 |
| 資産合計 | 742,290 |
| 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 | 449,059 |
| 評価・換算差額等合計 | 449,059 |

| | |
|---|---|
| 元本等合計 | 742,290 |
| 負債・元本等合計 | 742,290 |

＜損益計算書（注１）（注２）＞　　当計算期間（自 2025 年 5 月 1 日　至　2026 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） |
|---|---|
| 2025 年 5 月 30 日 | 19,738 |
| 2025 年 6 月 30 日 | 20,360 |
| 2025 年 7 月 31 日 | 22,280 |
| 2025 年 8 月 29 日 | 22,649 |
| 2025 年 9 月 30 日 | 22,913 |
| 2025 年 10 月 31 日 | 24,513 |
| 2025 年 11 月 28 日 | 25,717 |
| 2025 年 12 月 30 日 | 25,821 |
| 2026 年 1 月 30 日 | 25,167 |
| 2026 年 2 月 27 日 | 25,938 |
| 2026 年 3 月 31 日 | 24,570 |
| 2026 年 4 月 30 日 | 24,743 |