■仕組債リスクリターンの開示

2023年9月末現在

償還済銘柄

- 当社で販売した仕組債で、2018年4月～2023年9月の間に償還（早期償還含む）したもの、もしくは2016年４月以降発行のものが対象です。
- 横軸の「トータルリターン」は、各銘柄の年率換算したトータルリターン（利息の合計額と元本損益を合算した値により算出）を示しています。
- 縦軸の「本数（回数）」は、年率換算したトータルリターンによる１年間の投資を何回（本）行うことができたかを示しています。

（例：3年満期の 仕組債の年換算トータルリターンが5%の場合、5%に3本（回）分を計上）

- リターンは横軸の各銘柄の年率換算したトータルリターンにより、リスクは横軸のトータルリターンのばらつきにより表現しています。
- このグラフには、中途売却を行った場合のリターンは含まれていません。
- このグラフは当社における過去の販売実績に基づくものであり、本仕組債の将来のリスクとリターンについて何らの示唆を与えるものではありません。
  また、このグラフは本仕組債への投資を推奨する目的で作成されたものではありません。

未償還銘柄

- 当社で販売した仕組債で、2023年9月時点で未償還のものが対象です。
- 横軸の「トータルリターン」は、各銘柄の年率換算したトータルリターン（支払済の利息の合計額と分析時点の時価を合算した値により算出。時価は2023年9月時点の値）を示しています。

※仕組債時価は残存期間中（未償還）は100%を下回ることが多いため、トータルリターンはマイナスとなる傾向にあります

- 縦軸の「本数（回数）」は、年率換算したトータルリターンによる１年間の投資を何回（本）行うことができたかを示しています。

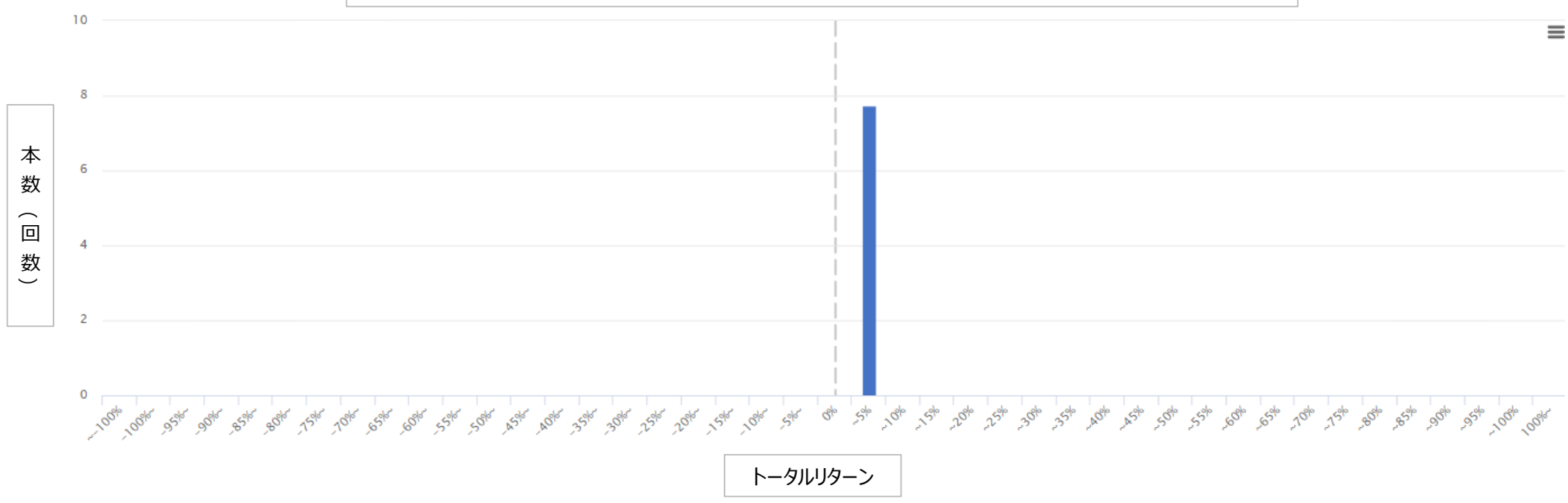
（例：3年満期の 仕組債の分析時点における投資期間が２年、年換算トータルリターンが5%の場合、5%に２本（回）分を計上）

- このグラフは当社における過去の販売実績に基づくものであり、本仕組債の将来のリスクとリターンについて何らの示唆を与えるものではありません。
  また、このグラフは本仕組債への投資を推奨する目的で作成されたものではありません。

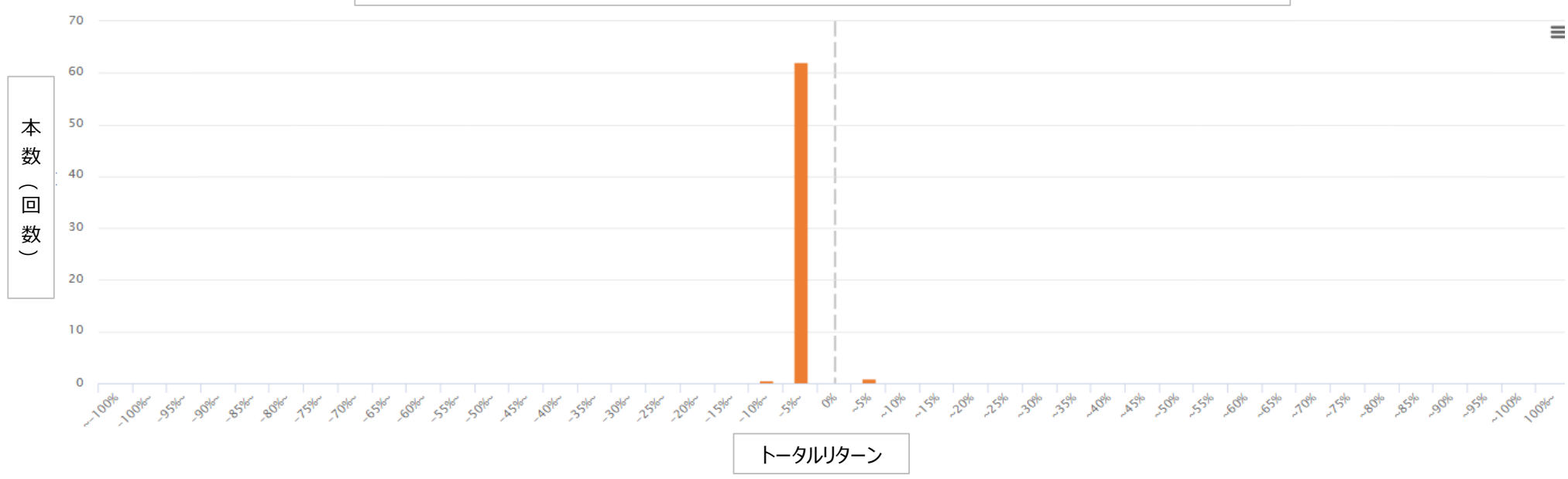
※外貨建て債券については、発行時、利払い時、償還時の為替レートで円貨換算したうえで算出しております
※当社で今後公募として取り扱う予定のない種類の仕組債、特定のお客さま向けに販売した少数の仕組債については非開示としております

公募仕組債

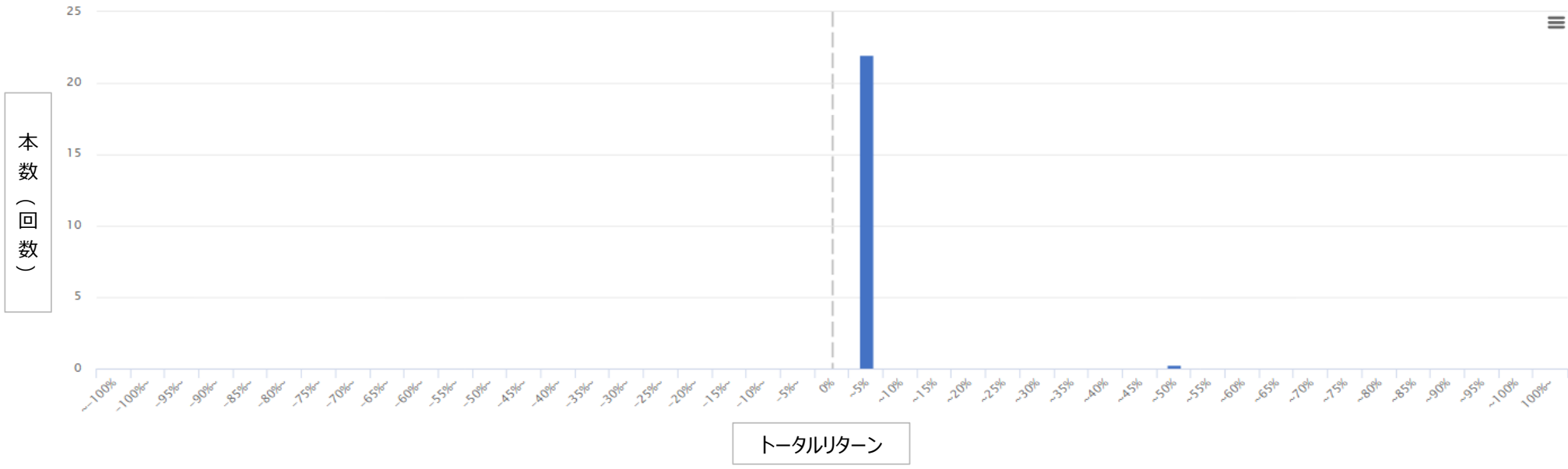
当社の取り扱ったコーラブル債のリスクとリターン実績（償還済）（4銘柄）



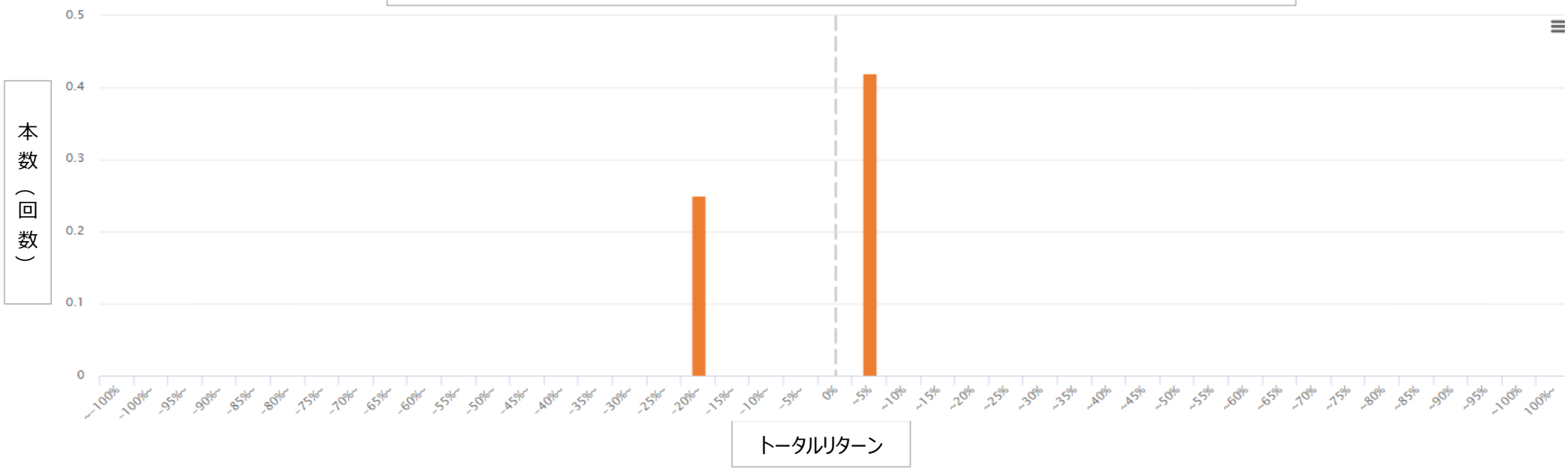
当社の取り扱ったコーラブル債のリスクとリターン実績（未償還）（26銘柄）



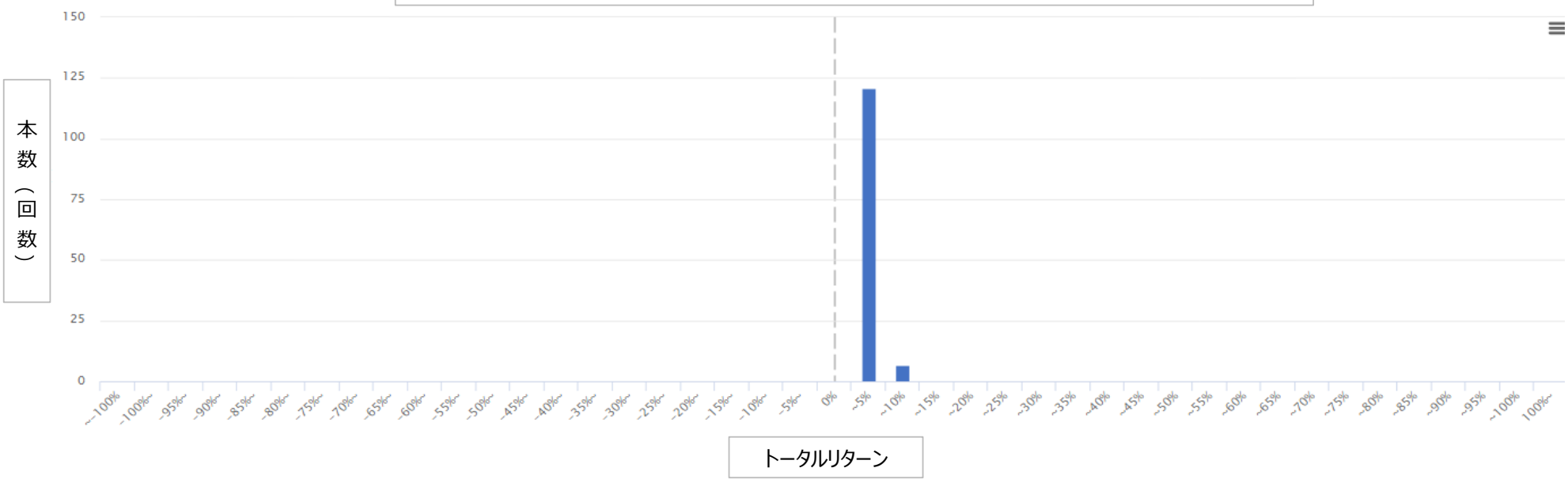
当社の取り扱った日経リンク債のリスクとリターン実績（償還済）（26銘柄）



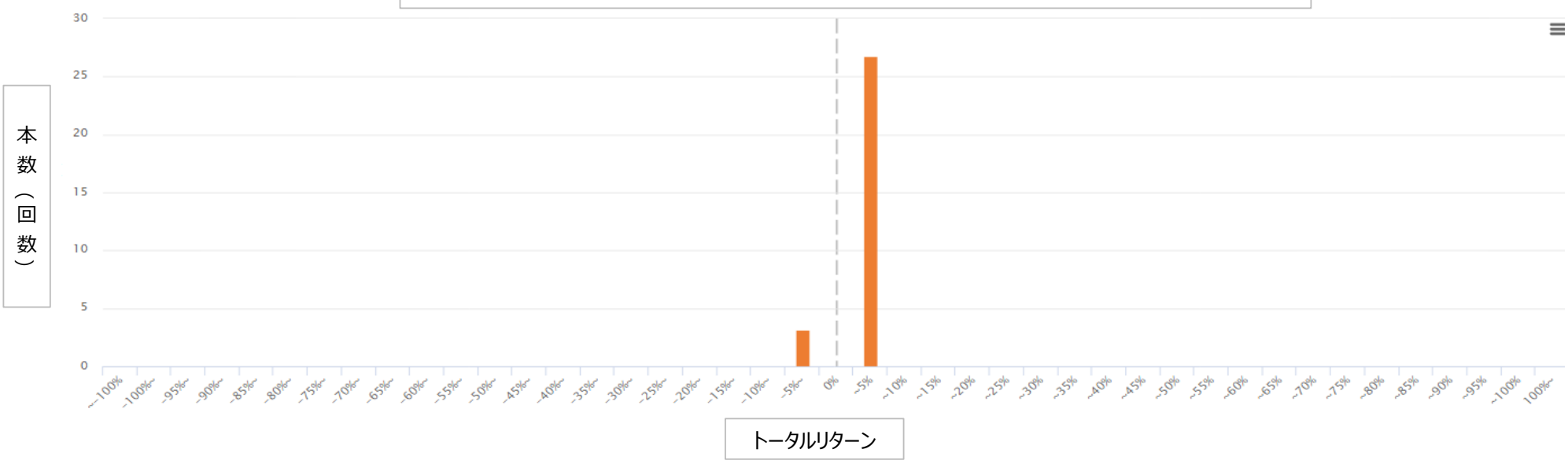
当社の取り扱った日経リンク債のリスクとリターン実績（未償還）（2銘柄）



当社の取り扱った日米2指数リンク債のリスクとリターン実績（償還済）（113銘柄）

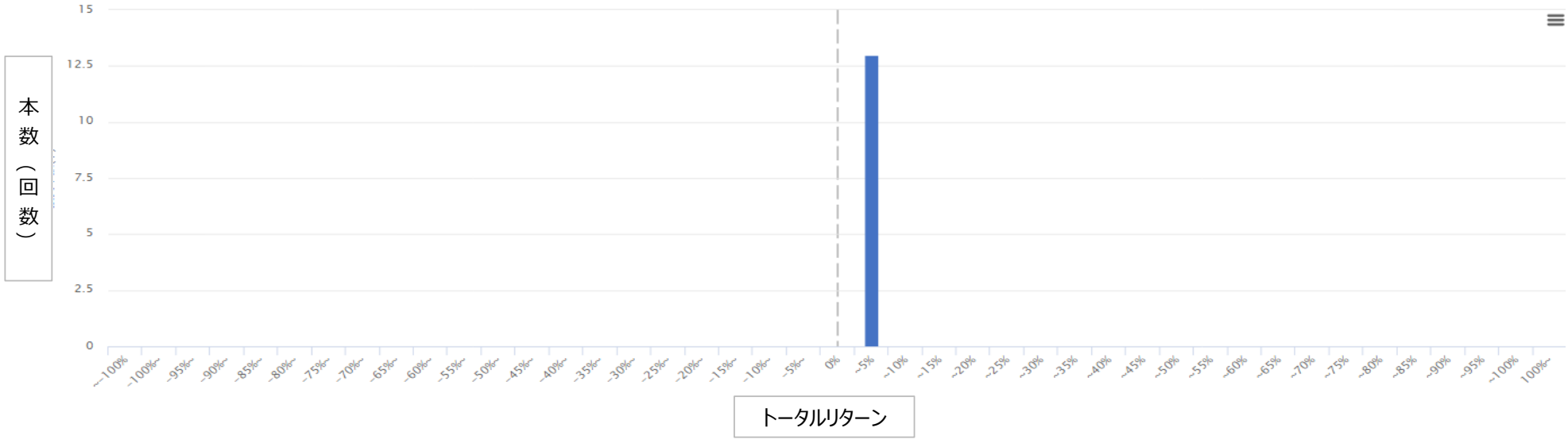


当社の取り扱った日米2指数リンク債のリスクとリターン実績（未償還）（17銘柄）

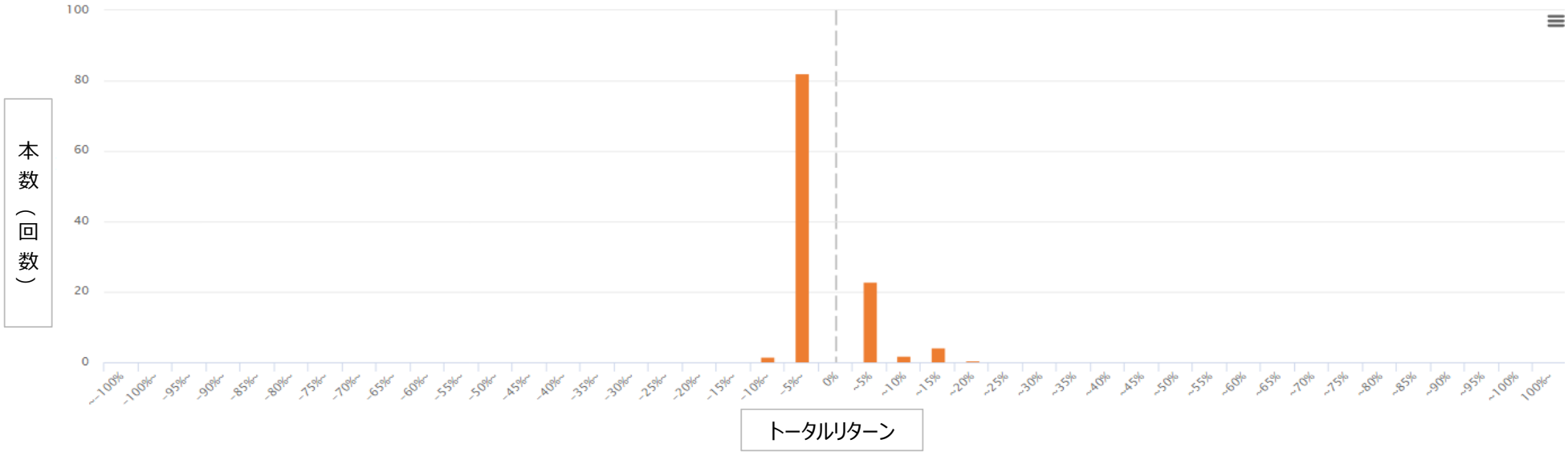


私売出仕組債

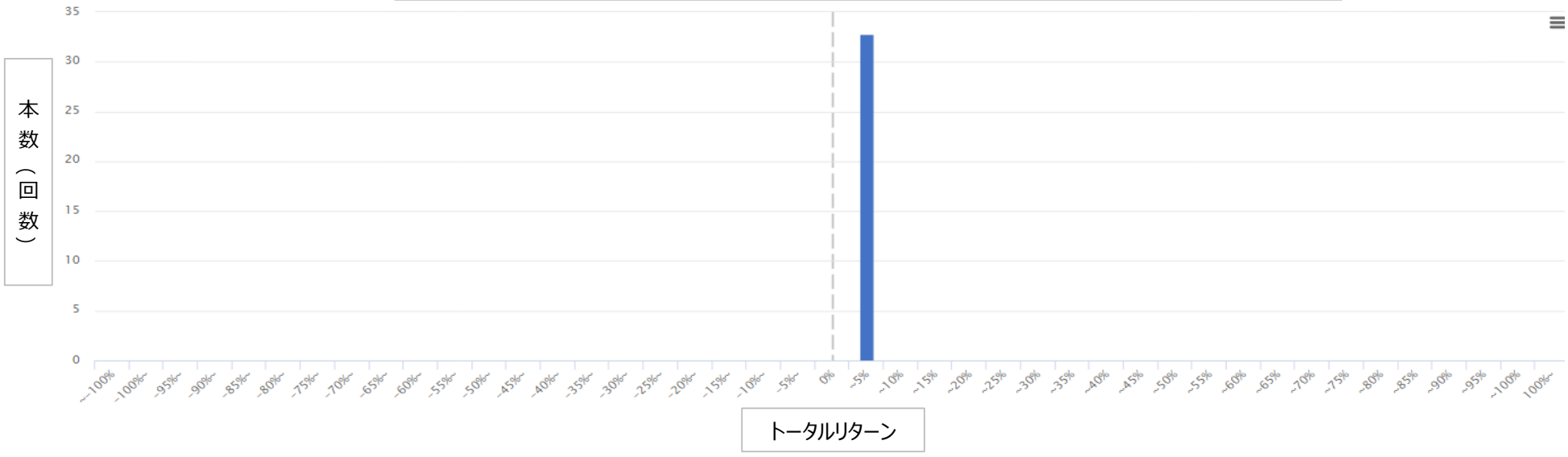
当社の取り扱ったコーラブル債のリスクとリターン実績（償還済）（7銘柄）



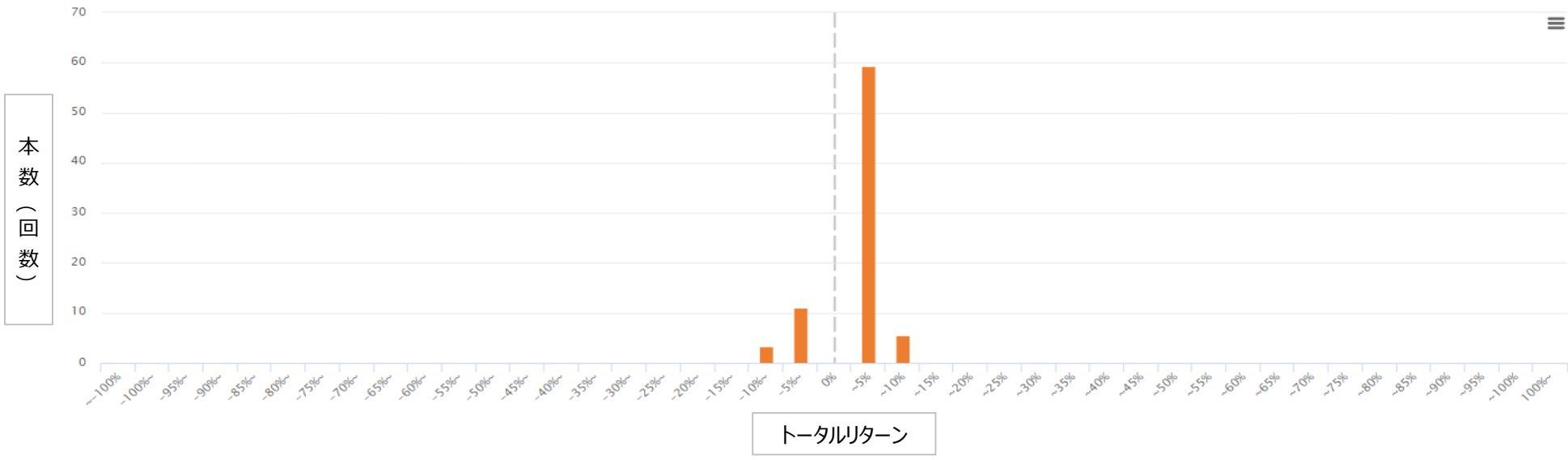
当社の取り扱ったコーラブル債のリスクとリターン実績（未償還）（33銘柄）



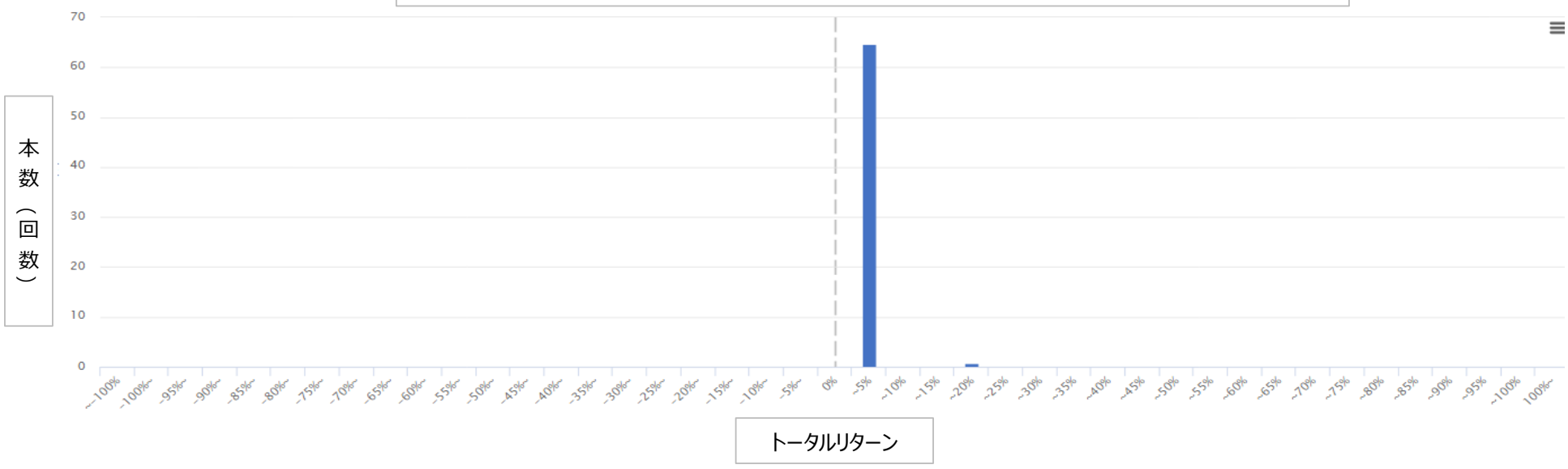
当社の取り扱ったクレジットリンク債のリスクとリターン実績（償還済）（12銘柄）



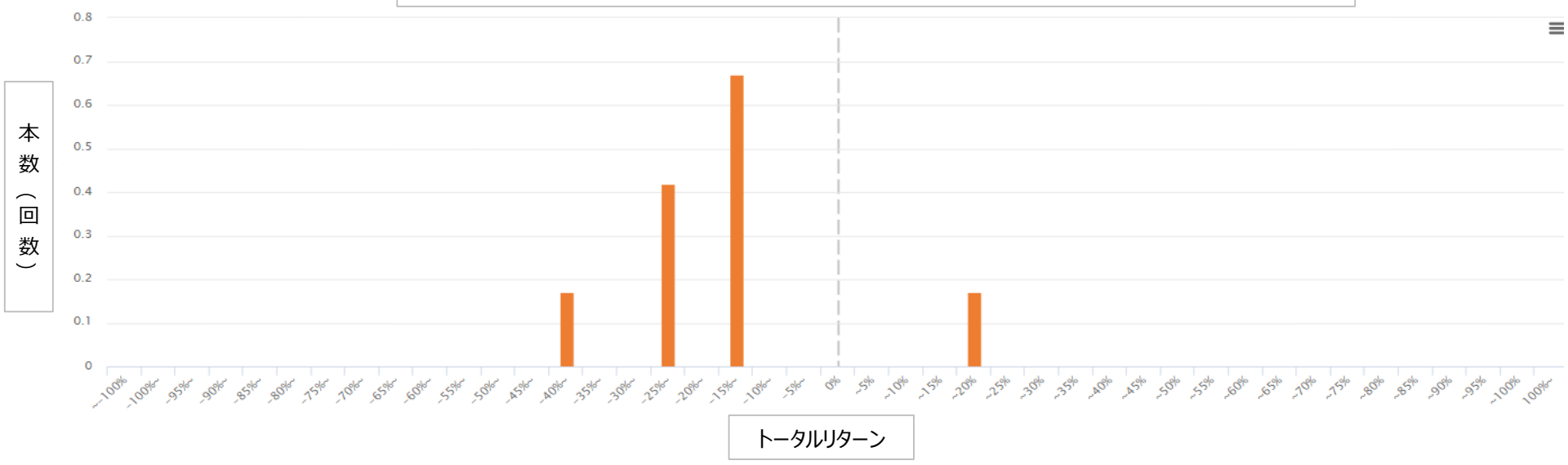
当社の取り扱ったクレジットリンク債のリスクとリターン実績（未償還）（32銘柄）



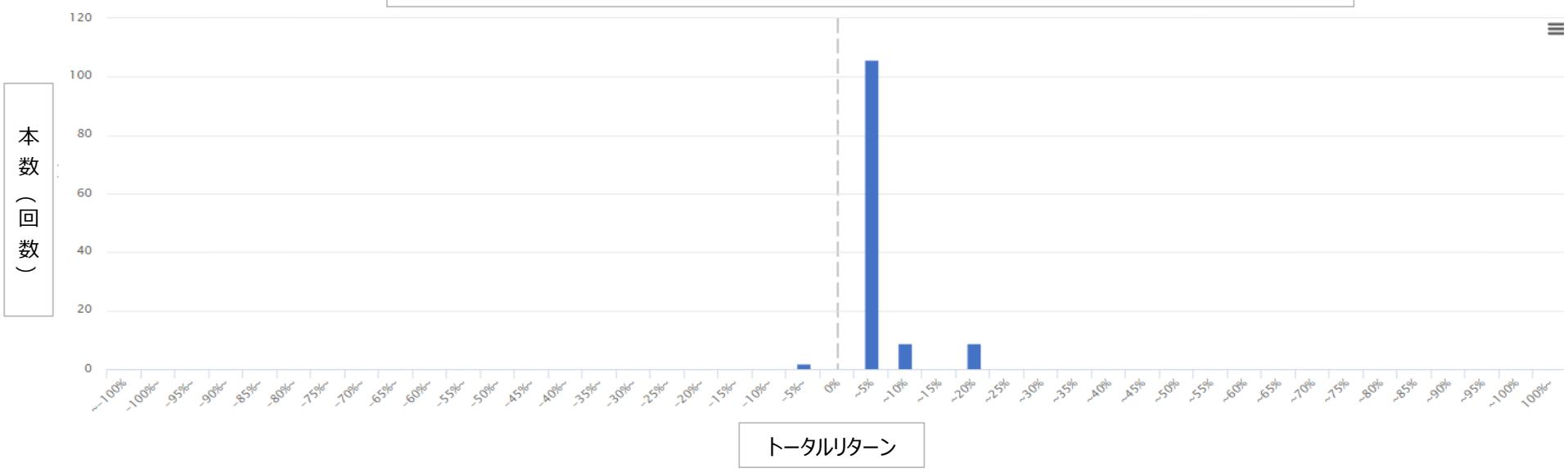
当社の取り扱った日経リンク債のリスクとリターン実績（償還済）（62銘柄）



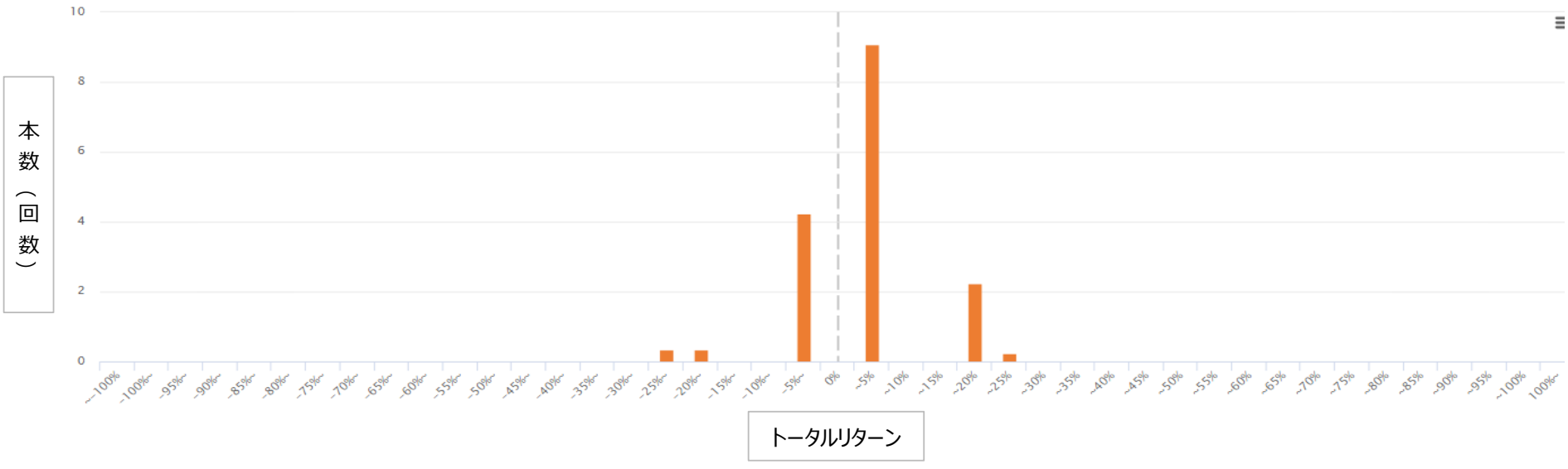
当社の取り扱った日経リンク債のリスクとリターン実績（未償還）6銘柄）



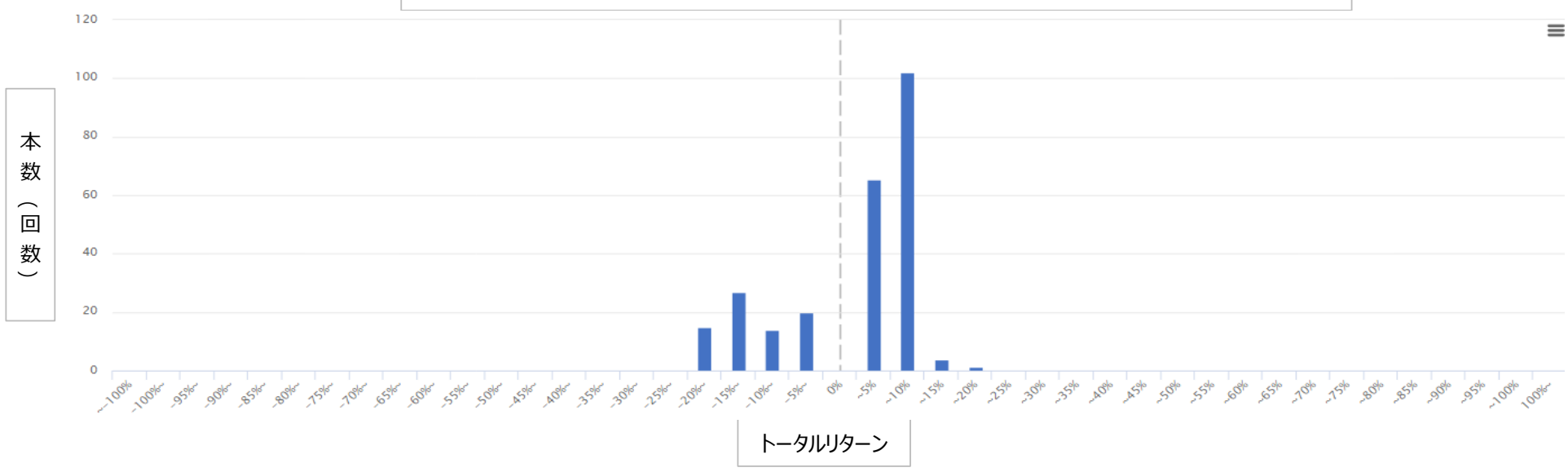
当社の取り扱った日米2指数リンク債のリスクとリターン実績（償還済）（114銘柄）



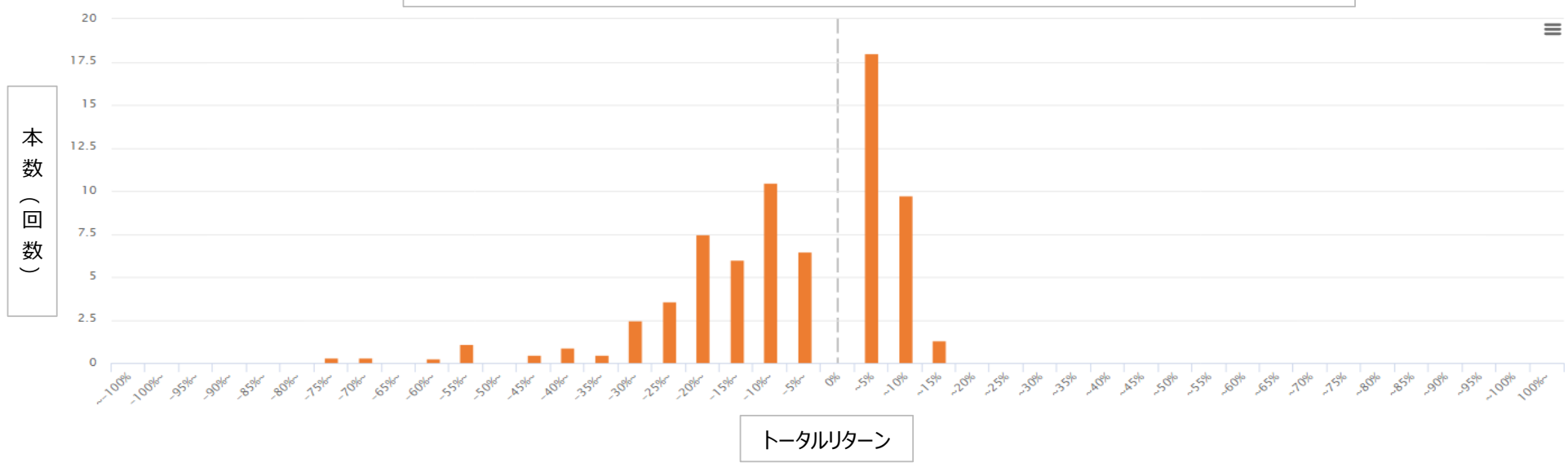
当社の取り扱った日米2指数リンク債のリスクとリターン実績（未償還）（17銘柄）



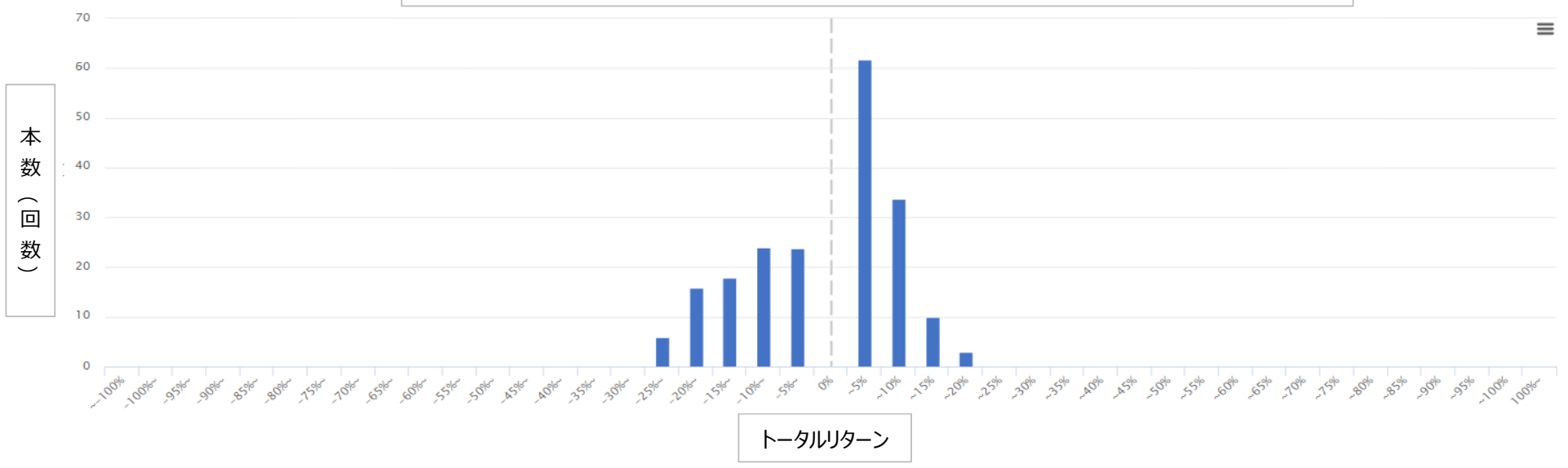
当社の取り扱ったEB（日本株参照）のリスクとリターン実績（償還済）（260銘柄）



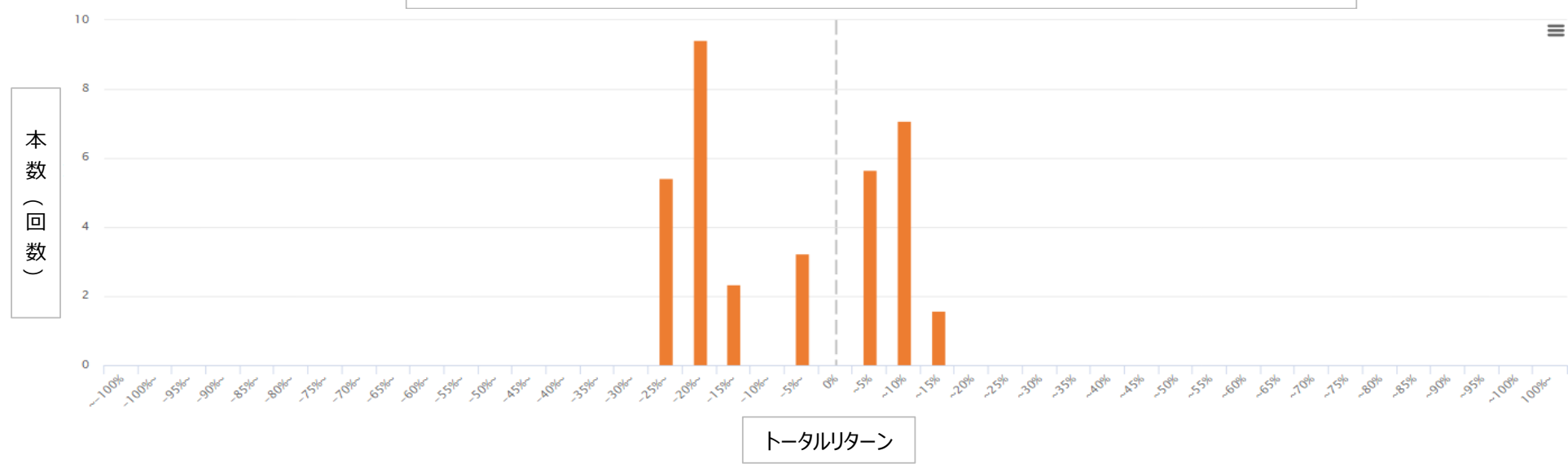
当社の取り扱ったEB（日本株参照）のリスクとリターン実績（未償還）（96銘柄）



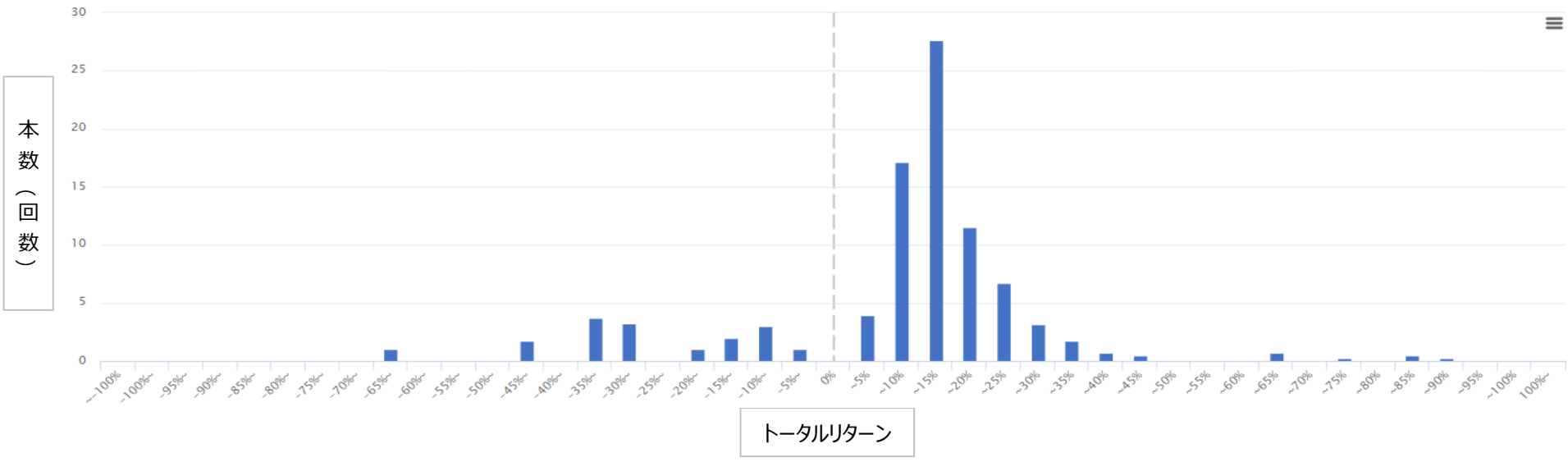
当社の取り扱ったEB（日本株2銘柄参照）のリスクとリターン実績（償還済）（133銘柄）



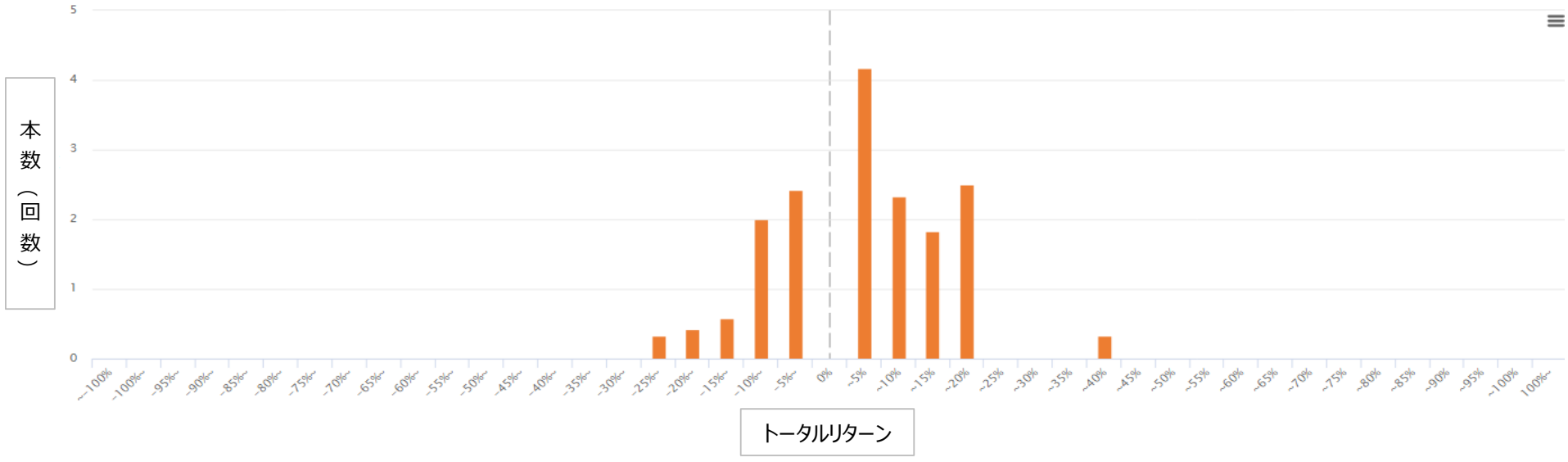
当社の取り扱ったEB（日本株2銘柄参照）のリスクとリターン実績（未償還）（22銘柄）



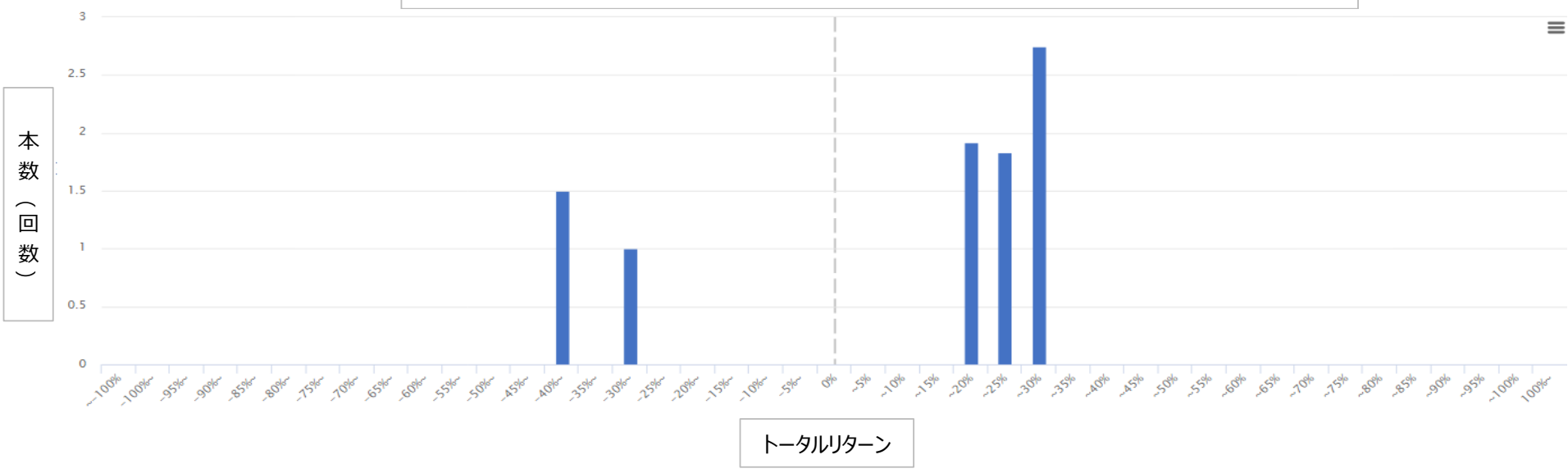
当社の取り扱ったEB（米国株参照）のリスクとリターン実績（償還済）（168銘柄）



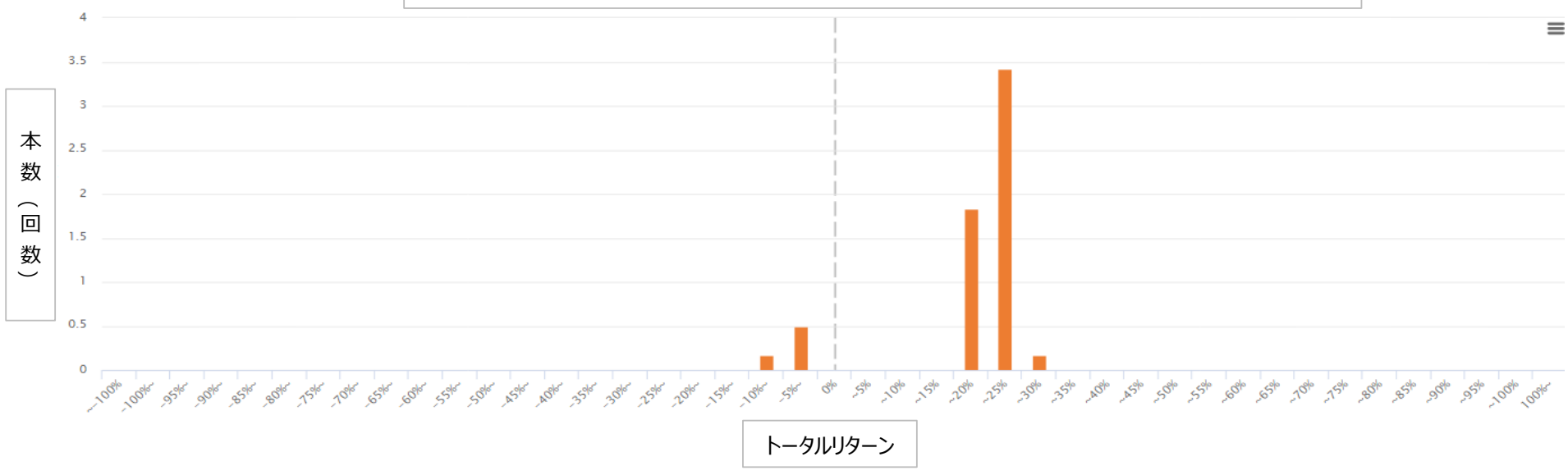
当社の取り扱ったEB（米国株参照）のリスクとリターン実績（未償還）（38銘柄）



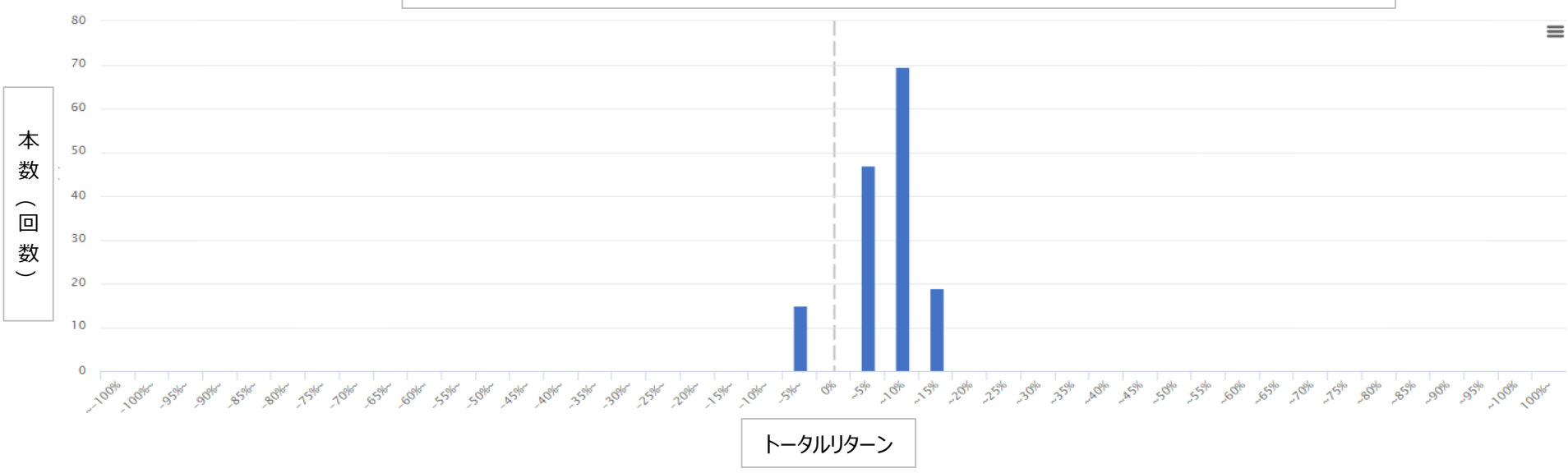
当社の取り扱ったEB（米国株2銘柄参照）のリスクとリターン実績（償還済）（10銘柄）



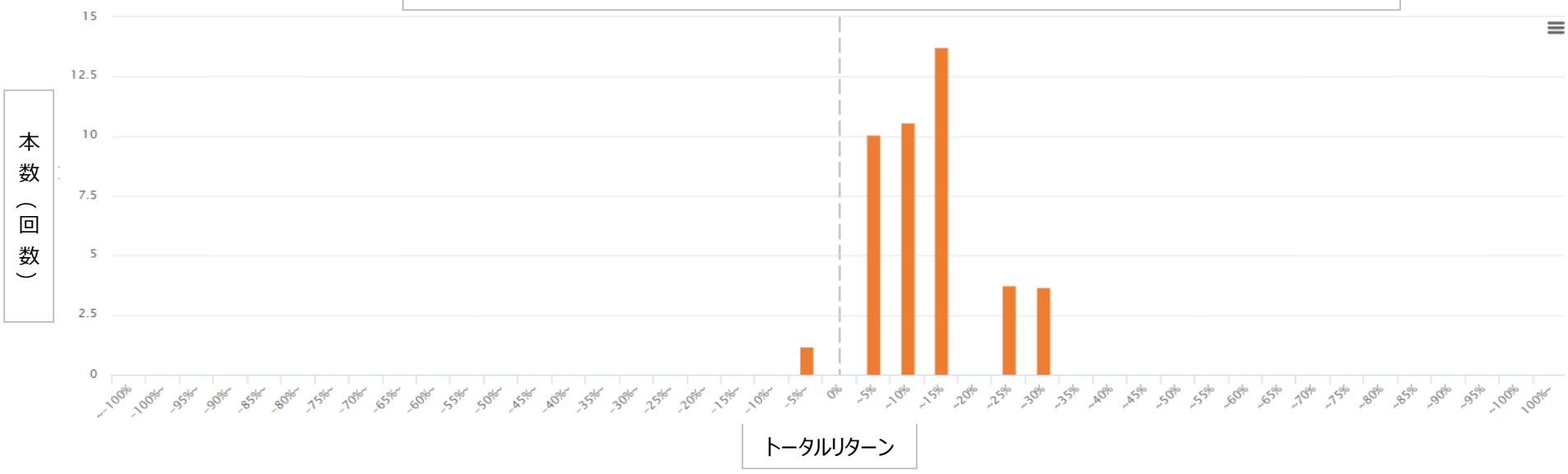
当社の取り扱ったEB（米国株2銘柄参照）のリスクとリターン実績（未償還）（6銘柄）



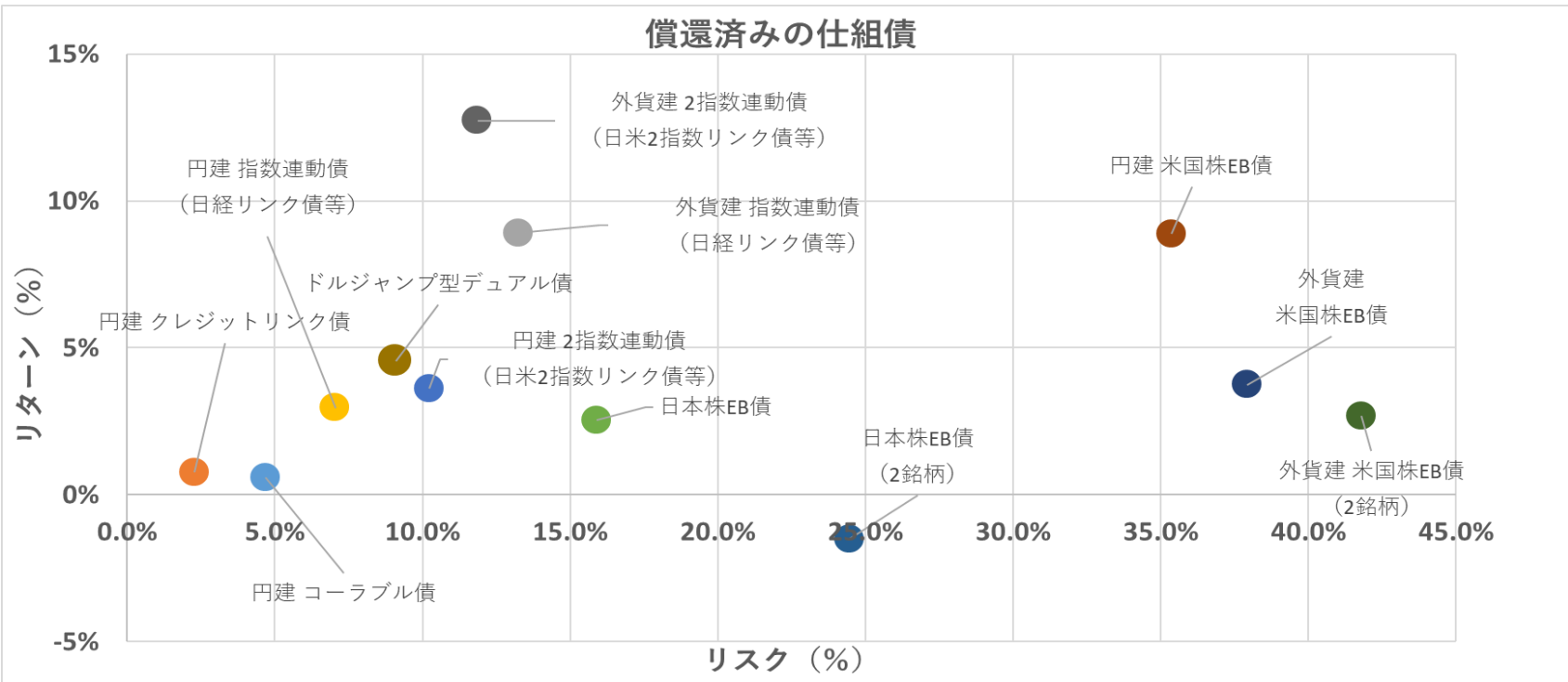
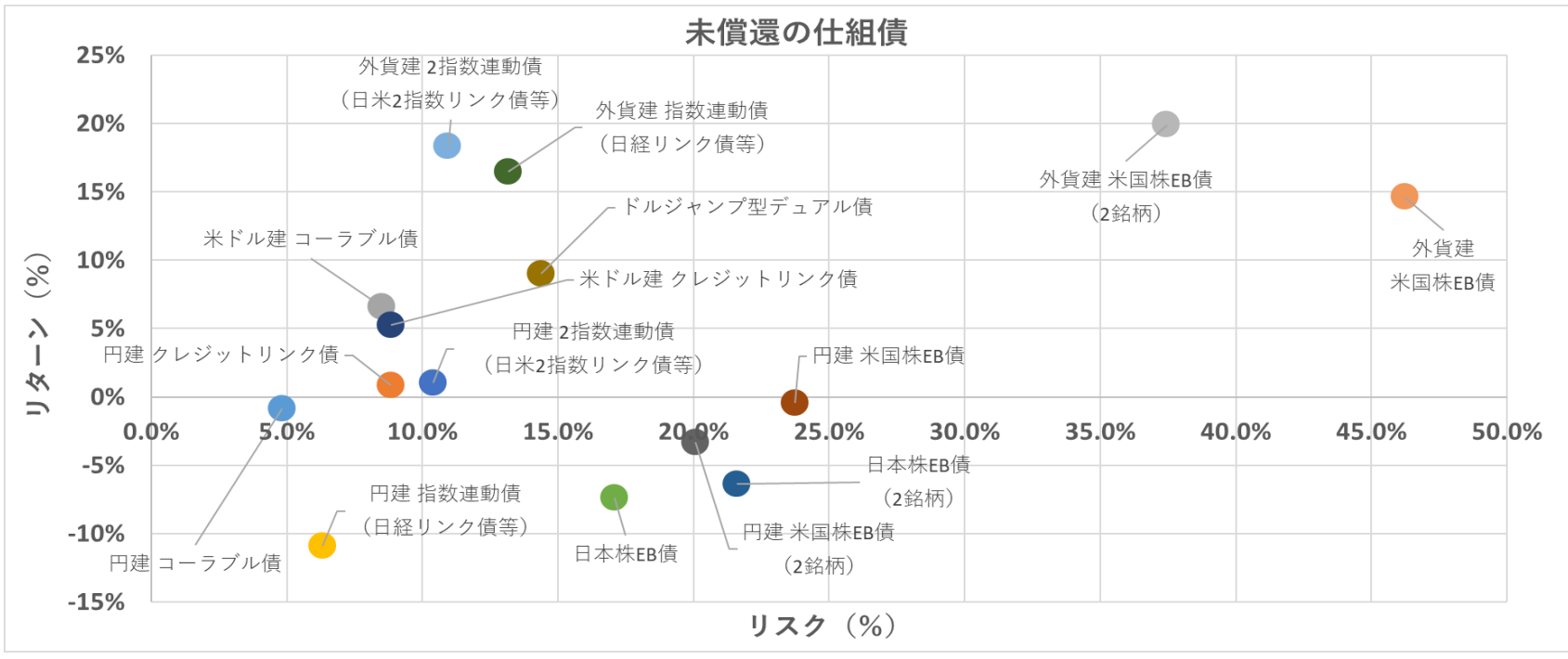
当社の取り扱ったスーパーボール債（米ドルジャンプ債）のリスクとリターン実績（償還済）（28銘柄）



当社の取り扱ったスーパーボール債（米ドルジャンプ債）のリスクとリターン実績（未償還）（17銘柄）



（参考資料）

	債券名称	償還済 銘柄数	償還済 リスク	償還済 平均リターン	償還済 最大リターン	償還済 最小リターン	未償還 銘柄数	未償還 リスク	未償還 平均リターン	未償還 最大リターン	未償還 最小リターン
1	円建 コーラブル債	11	4.68%	0.58%	1.24%	0.33%	51	4.84%	-0.86%	2.17%	-17.04%
	米ドル建 コーラブル債	—	—	—	—	—	8	8.49%	6.59%	18.66%	2.31%
2	円建 クレジットリンク債	12	2.26%	0.77%	1.20%	0.30%	30	8.85%	0.85%	8.89%	-8.23%
	米ドル建 クレジットリンク債	—	—	—	—	—	2	8.84%	5.24%	9.51%	-1.32%
3	デュアルカレンシー債	—	—	—	—	—	1	20.06%	6.15%	6.15%	6.15%
4	マルチアセット指数連動債	—	—	—	—	—	1	8.06%	-20.22%	-20.22%	-20.22%
	米ドル建 マルチアセット指数連動債	—	—	—	—	—	3	8.96%	-3.33%	1.43%	-26.71%
5	円建 指数連動債（日経リンク債等）	82	7.05%	2.95%	4.60%	1.30%	6	6.33%	-10.88%	0.25%	-36.50%
	外貨建 指数連動債（日経リンク債等）	20	13.23%	8.92%	66.30%	-11.77%	3	13.17%	16.48%	20.53%	12.65%
6	円建 2指数連動債（日米2指数リンク債等）	215	10.24%	3.63%	7.06%	0.99%	31	10.38%	1.03%	2.37%	-21.98%
	外貨建 2指数連動債（日米2指数リンク債等）	12	11.87%	12.73%	24.13%	-3.20%	3	10.94%	18.30%	21.38%	17.71%
7	日本株EB債	267	15.88%	2.55%	16.08%	-17.41%	96	17.07%	-7.34%	14.80%	-74.08%
8	日本株EB債（2銘柄）	208	24.44%	-1.50%	35.21%	-28.14%	22	21.58%	-6.36%	12.78%	-23.52%
9	円建 米国株EB債	125	35.35%	8.87%	29.83%	-40.99%	34	23.75%	-0.42%	16.33%	-24.68%
	外貨建 米国株EB債	43	37.93%	3.74%	88.63%	-60.71%	4	46.24%	14.60%	35.25%	7.03%
10	円建 米国株EB債（2銘柄）	5	44.53%	21.68%	25.31%	18.75%	2	20.07%	-3.31%	-2.61%	-7.53%
	外貨建 米国株EB債（2銘柄）	5	41.80%	2.68%	26.94%	-33.60%	4	37.45%	19.89%	27.98%	16.13%
11	ドルジャンプ型デュアル債	37	9.09%	4.55%	13.25%	-2.54%	17	14.37%	9.02%	25.34%	-3.04%

リターン：トータルリターン（償還済み：クーポンと元本損益を合算、未償還：クーポンと分析時点の時価を合算）を販売金額と投資期間で加重平均
リスク：年率換算したトータルリターンを販売金額と投資期間で重み付けしたものの標準偏差
※未償還については、流動性が低く時価が100を下回るものがほとんどのため、保有期間中のリターンはマイナスが多くなる。