

# 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社

2023年1月11日満期

## 期限前償還条項・円償還条項付 円／豪ドル デュアル・カレンシー社債



年利率 **1.00%** (税引後 0.796%\*)

期間 **約1年** 発行者の選択により、最短の場合約6か月で  
期限前償還される場合があります

※税引後の利率は、20.315%の税金が差し引かれた利率であり、小数点以下第3位未満を切り捨てて表示しています。

お申込期間:2022年1月18日(火)～2022年1月24日(月)

### <本債券の特徴>

- お申込代金・利息は円ですが、満期償還の場合、円又は外貨で償還されます。
- 為替レートの変動リスクをとることにより、一般的な同期間の円建固定利付債と比較して、相対的に高い金利を享受できる可能性があります。ただし、為替変動の影響を受け損失が生じる場合があります。
- 発行者の選択により、満期償還日より前に期限前償還される場合があります。

※償還については、中面をご参照ください。

### <売出要項>

- |          |                                                               |          |                                                                         |
|----------|---------------------------------------------------------------|----------|-------------------------------------------------------------------------|
| ■発行 者    | 三菱UFJ証券ホールディングス株式会社                                           | ■売 出 価 格 | 額面金額の100%                                                               |
| ■発行 日    | 2022年1月24日<br>※利息起算日:2022年1月25日                               | ■申 込 単 位 | 100万円以上、100万円単位                                                         |
| ■受 渡 期 日 | 2022年1月25日                                                    | ■格 付*    | A-(S&P) A1 (Moody's)<br>AA-(R&I) AA (JCR)<br>長期発行者格付<br>(2021年12月21日現在) |
| ■利 払 日   | 初回:2022年4月11日<br>2回目以降:2022年7月・10月・2023年1月の各11日               |          |                                                                         |
| ■償 還 日   | 満 期 償 還 日: 2023年1月11日<br>期 限 前 償 還 日: 2022年7月11日及び2022年10月11日 |          |                                                                         |

\*格付について

- ・本格付は、今後見直しが行われる可能性があります。

— 「主なリスク」及び「ご投資にあたっての留意点」を必ずご確認ください。 —

oFG おきなわフィナンシャルグループ



おきぎん証券株式会社 金融商品取引業者 沖縄総合事務局長(金商)第1号  
加入協会:日本証券業協会

## 償還について

### 期限前償還

■ 発行者の選択により、いずれかの期限前償還日に額面金額の100%の円で期限前償還される場合があります(最短の場合、約6ヵ月で期限前償還される場合があります)。

※一般的に、円高・豪ドル安になるほど期限前償還される可能性は低くなり、逆に円安・豪ドル高になるほど期限前償還される可能性は高くなると考えられます。ただし、期限前償還されるか否かは、あくまで発行者の選択によります。

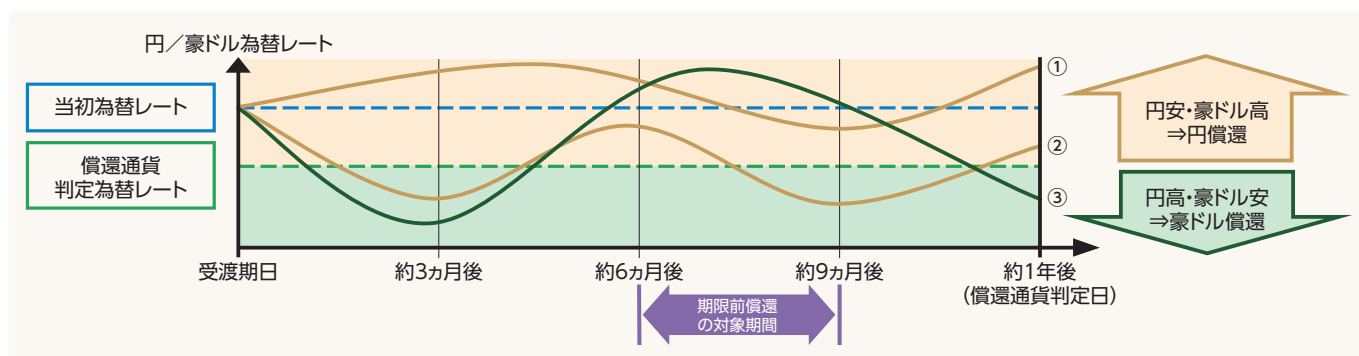
### 満期償還

■ 期限前償還されなかった場合、円又は豪ドルで満期償還日に償還されます。

<償還為替レートが、償還通貨判定為替レートと同じ、又はより円安・豪ドル高の場合(下図①、②)>  
⇒ 額面金額の100%で円償還

<償還為替レートが、償還通貨判定為替レートより円高・豪ドル安の場合(下図③)>

⇒ 額面金額100万円につき、以下の計算式で計算される金額で豪ドル償還 ※1豪セント未満を四捨五入  
100万円 ÷ 当初為替レート



※償還為替レートが、当初為替レートよりも円安・豪ドル高となった場合(上図①)でも、本債券の償還金額は額面金額100%の円貨となります。

※豪ドル償還の場合(上図③)、満期償還日時点において円換算した償還金額は、投資元本を下回る可能性が高いと考えられます。

■ 当初為替レート…… 2022年1月25日における参照為替レート

■ 参照為替レート…… Bloomberg画面「BFIX」のMidページに表示される午後3時(東京時間)における円/豪ドル為替レート

■ 償還通貨判定為替レート…… 当初為替レート - (未定)円/豪ドル(仮条件\*:4.00 ~ 17.00円/豪ドル)  
※2022年1月17日までに決定される予定の上記未定の条件は、仮条件の範囲外となる場合があります。

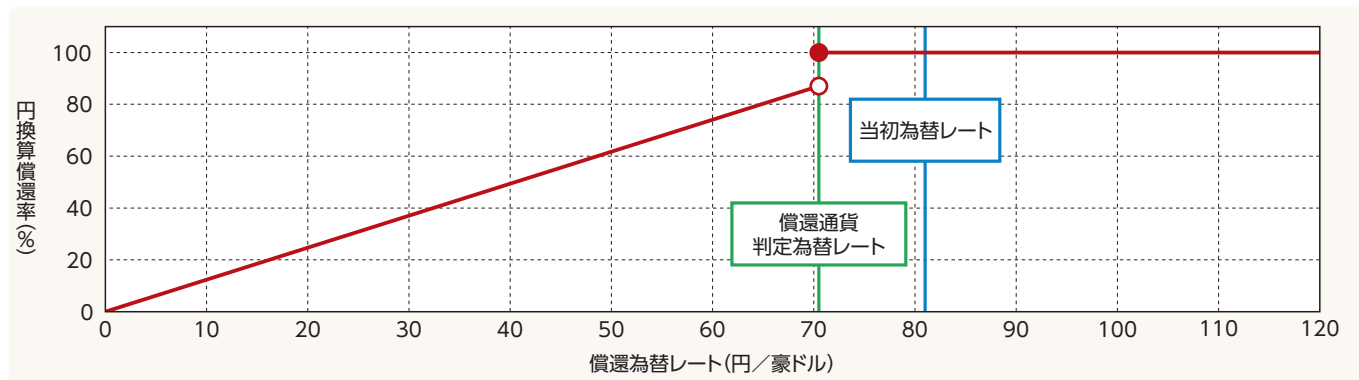
■ 償還為替レート…… 償還通貨判定日における参照為替レート

■ 償還通貨判定日…… 満期償還日の10営業日\*前の日

\* 営業日については目論見書をご参照ください。

### <償還為替レートと償還率>

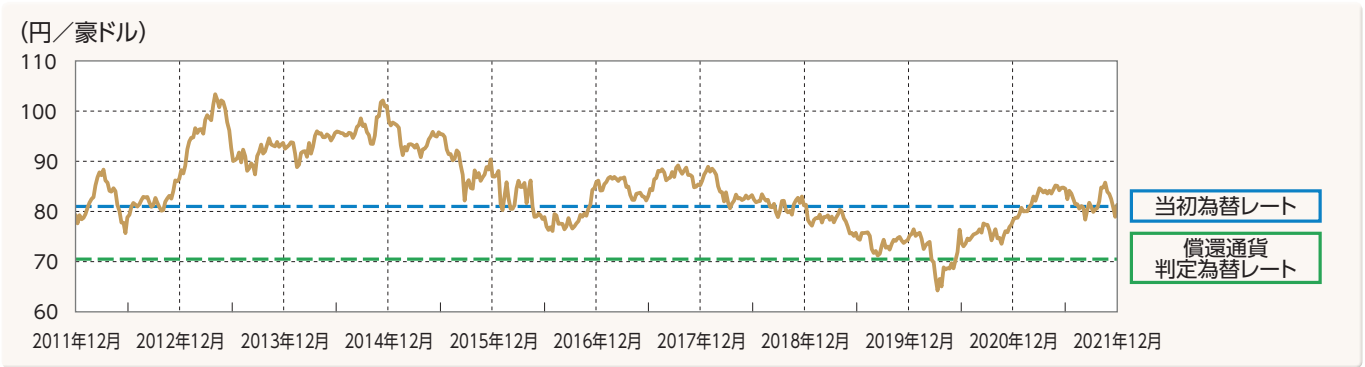
(仮定条件)当初為替レート 81.00円/豪ドル 償還通貨判定為替レート 70.50円/豪ドル



※豪ドル償還での円換算償還率は、償還為替レートをもとに算出しています。

満期償還日の円/豪ドル為替レートと償還為替レートは相場状況により異なります。

**<ご参考>円／豪ドル為替レートの過去の推移及び償還通貨判定為替レートのイメージ**  
 [仮定条件]当初為替レート 81.00円／豪ドル 償還通貨判定為替レート 70.50円／豪ドル



出所:Bloomberg L.P.

**▲** 上記の為替推移は過去のデータです。また、当初為替レート及び償還通貨判定為替レートは仮定条件であり、実際の数値とは異なります。したがって上記の内容は、将来の投資結果及び市場環境等を保証もしくは予想するものではありません。

## 発行者概要

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社は、株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ(MUFG)100%出資の証券持株会社です。

三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社のほか、海外で証券・投資銀行業務を担う子会社等があります。これらの傘下子会社の管理運営、業務支援等を行うことでMUFGグループの証券・投資銀行戦略全般を担っています。

出所：「三菱UFJ証券ホールディングス株式会社 会社情報 MUFGグループの一員として」(2021年12月21日における発行者のHP)

※上記発行者概要は公開情報に基づき作成されておりますが、内容の確実性あるいは完全性を保証するものではありません。

また、本資料に記載された情報は今後通知なく変更される場合があります。

## 主なリスク

- 本債券は、参照する為替レートが一定水準を超える円高となった場合、外貨で償還されることがあります。その結果、円換算した満期償還金額が投資元本を割り込むことがあります。
- 本債券の価格は、円高、外貨金利の上昇、外貨と円の金利差の拡大等により、購入価格を下回り損失が生じるおそれがあります。
- 本債券は、発行者又は保証会社等の信用状況に変化が生じた場合、本債券の市場価格が変動することによって損失が生じるおそれがあります。
- 本債券に関する流通市場は確立されていないため、中途売却できない可能性及び購入価格を大きく下回る価格での売却となる可能性があります。
- 本債券が期限前償還され、再投資を行う場合、市場実勢によっては再投資運用利回りが低下することがあります。また、期限前償還された場合には、期限前償還日以降の利息は生じません。

## 想定損失額について

以下は、本債券の価格に影響を与える主な金融指標等(以下、「対象金融指標等」といいます)のヒストリカルデータに基づく、最悪シナリオを想定した本債券の想定損失額のシミュレーションです。  
本シミュレーションは試算日(2021年12月13日)の市場環境に基づく簡易な手法により試算したものであり、将来の実際における損失額を示すものではありません。

### 1.対象金融指標等

円/豪ドル為替レート  
豪ドル金利

### 2.試算の前提となるヒストリカルデータ

#### ■対象為替レートの最大下落率

対象為替レート	最大下落率*	観測期間	
		開始日	終了日
円/豪ドル	49%	1990年4月1日	2021年11月30日

※観測期間における、各取引日を起算日とした1年間の期中下落(円高・豪ドル安)率のうち、最大のもの

#### ■「期中の想定損失額」の算出にあたって考慮されるその他の参照指標の最大変動幅等

金融指標	最大変動幅*	観測期間	
		開始日	終了日
豪ドル金利	5.70%	1993年12月9日	2021年11月30日

※観測期間における、1年物豪ドルスワップレートの1年間の最大変動幅

(出所:Bloomberg L.P.)

### 3.満期償還時の想定損失額

対象為替レートである円/豪ドル為替レートが、当初為替レートより上記ヒストリカルデータと同様に下落した場合の、満期償還時における想定損失額は以下の通りです。

額面に対する想定損失額	49%
-------------	-----

### 4.期中の想定損失額

下記の仮定条件に基づき、本債券の発行直後において対象金融指標等が上記ヒストリカルデータと同様に変動した場合の、期中の想定損失額は以下の通りです。

<仮定条件>

- ・当初為替レート:81.00円/豪ドル
- ・償還通貨判定為替レート:70.50円/豪ドル

額面に対する想定損失額	51%
-------------	-----

### 5.ご留意事項

- ・前提とするヒストリカルデータを上回る市場変化が生じた場合等には、上記の想定損失額を超える損失が発生する可能性があります。
- ・発行者(含、保証会社等)のデフォルト等、市場環境次第では、上記の想定損失額に関わらず、投資額のほぼ全額を毀損する可能性があります。
- ・本債券に関する流通市場は形成されておらず、また将来形成される予定もないため、中途売却できる保証はありません。
- ・中途売却時における実際の売却価格は、売却時における本債券の流動性及び残存期間の利回り水準等も影響するため、算出することができません。本試算では、期中の想定損失額については受取利息を考慮した上で、対象金融指標等が上記ヒストリカルデータと同様に変動し、かつ発行直後に売却することを前提とした場合の理論値を算出しています。実際に売却する際には、試算した想定損失額を上回る損失が生じる可能性があります。

本書面に記載されたシミュレーションの内容、図表及びグラフは過去データや仮定条件に基づくものであり、将来の投資結果及び市場環境の変動等を保証もしくは予想するものではありません。

## ご投資にあたっての留意点

- 本債券は預金ではなく、元本・利回りは保証されていません。また、預金保険制度の対象ではありません。
- お申し込みにあたっては「仕組債の取引に係るご注意」「契約締結前交付書面」「本債券の想定損失額について」及び「目論見書」等をよくお読みいただいた上で、ご投資の最終決定はお客様ご自身にてなされるようお願いいたします。
- 本債券をご購入される場合には、外国証券取引口座の設定が必要となります。「外国証券取引口座約款」を必ずお受け取りください。
- 本債券をご購入される場合には、購入対価のみをお支払いいただきます。
- 販売会社によって申込単位が異なる場合があります。
- 販売額には限りがありますので、売切れの際はご容赦ください。また、市場環境の変化その他の理由により、販売が中止となる可能性があります。
- 本債券に関する価格情報については、販売会社までお問い合わせください。
- 利金・償還金のお支払いは各利払日・償還日の翌営業日以降となる場合があります。また、特にお申し出がない場合、償還金は円貨でのお支払いとなります。
- 本債券の償還等にあたり、円貨と外貨を交換する場合には、外国為替市場の動向をふまえて販売会社が決定する為替レートが適用されます。
- 個人のお客様の場合、利子所得、売却損益及び償還差損益は申告分離課税の対象となります。本債券の課税上の取扱いについては必ずしも明確ではなく、上記と異なる可能性があります。詳しくは税理士等の専門家にお問い合わせください。

— お申し込みにあたっては、必ず契約締結前交付書面及び目論見書等をご覧ください。—

お問い合わせは…

**【連絡先】** 本店 098-862-6125

おきぎん証券株式会社

金融商品取引業者 沖縄総合事務局長(金商)第1号 加入協会:日本証券業協会