

三菱UFJ証券ホールディングス株式会社

2025年7月11日満期 期限前償還条項付 日経平均株価連動 円建社債

申込期間：2022年7月19日(火)～2022年7月25日(月)

■ 年利率(税引前)

(仮条件※)

1.00～4.40%

※2022年7月15日までに決定される予定の上記未定の利率は、仮条件の範囲外となる場合があります。

■ 期間 約3年

最短の場合、約3ヵ月で期限前償還される場合があります。

<本債券の特徴>

- 日経平均株価の変動リスクを取ることで、一般的な同期間の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、日経平均株価の変動を受け損失が生じる場合があります。
 - 日経平均株価の動向により、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		
発行日	2022年7月25日	※利息起算日：2022年7月26日	
受渡期日	2022年7月26日	条件設定日	2022年7月26日
対象株価指数	日経平均株価		
利払日	初回：2022年10月11日 2回目以降：毎年1月、4月、7月、10月の各11日(年4回)		
償還日	満期償還日：2025年7月11日 期限前償還日：2022年10月11日から2025年4月11日までの各利払日		
売出価格	額面金額の100%	申込単位	100万円以上、100万円単位
格付*	A- (S&P) A1 (Moody's) AA- (R&I) AA (JCR) 長期発行者格付(2022年6月27日現在) *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。		

- 当初価格 …… 条件設定日における日経平均株価終値
- トリガー価格 …… 当初価格の100% ※0.01円未満を四捨五入
- ノックイン価格 …… 当初価格の65% ※0.01円未満を四捨五入

—「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



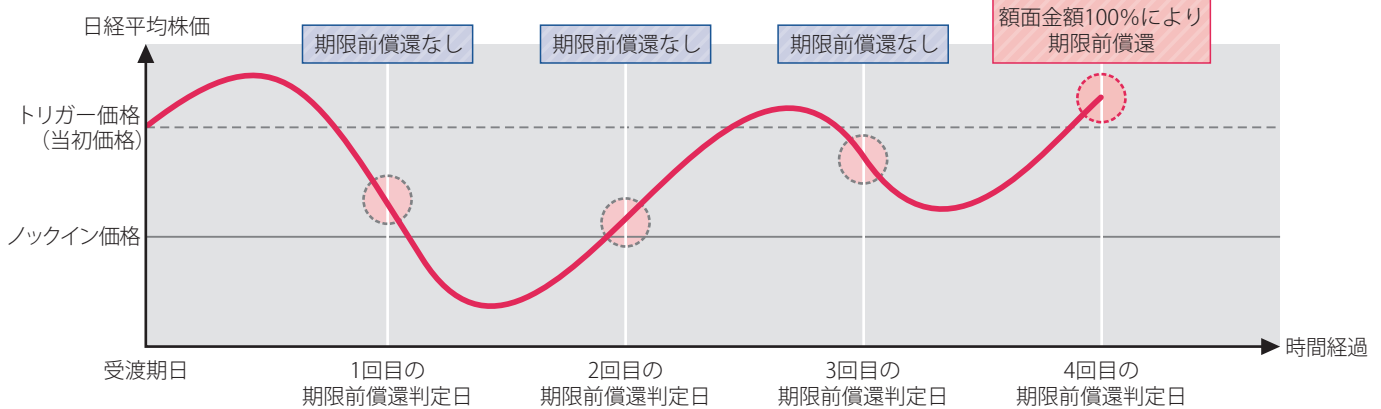
おきぎん証券株式会社 金融商品取引業者 沖縄総合事務局長(金商)第1号
加入協会：日本証券業協会

償還について

期限前償還 最短の場合、約3ヵ月で期限前償還されます。

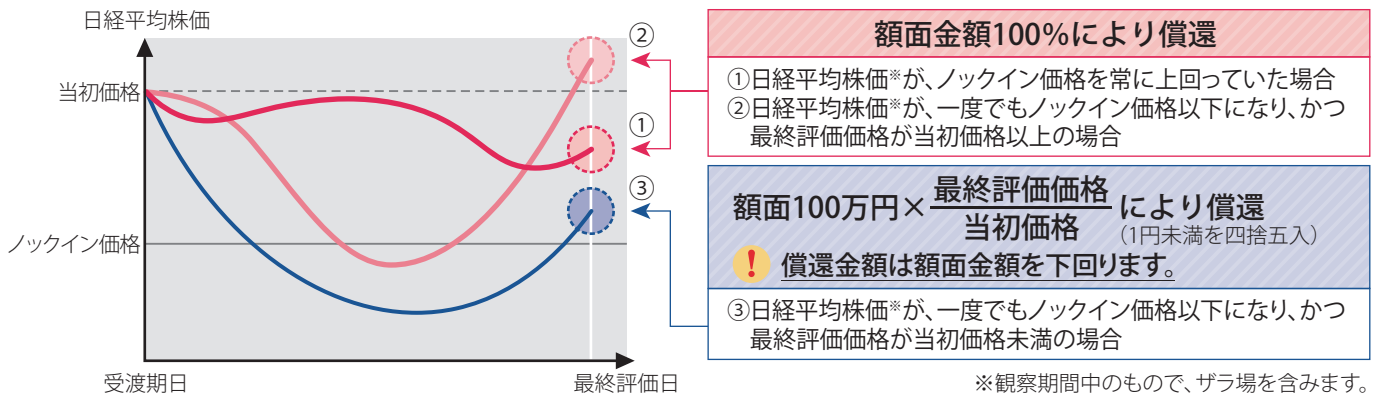
- 期限前償還判定日の日経平均株価終値がトリガー価格以上の場合、その直後の期限前償還日に額面金額の100%で期限前償還されます。
- ゼラ場を含めた日経平均株価がノックイン価格以下になった場合でも、上記事由が発生した場合は期限前償還されます。

■ 期限前償還のイメージ（4回目の期限前償還判定日に期限前償還が決定する場合）



期限前償還判定日……各期限前償還日の10取引所営業日前の日

満期償還 期限前償還されなかった場合、下記のいずれかの方法により満期償還日に償還されます。



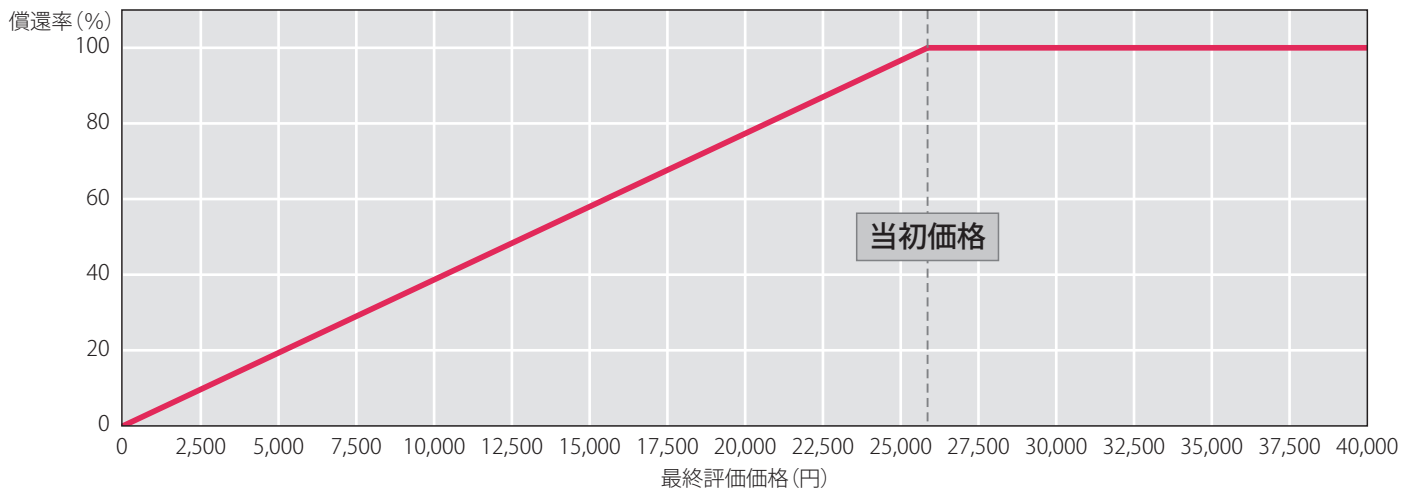
観 察 期 間……条件設定日の翌取引所営業日から最終評価日までの期間

最 終 評 価 日……満期償還日の10取引所営業日前の日

最終評価価格……最終評価日における日経平均株価終値

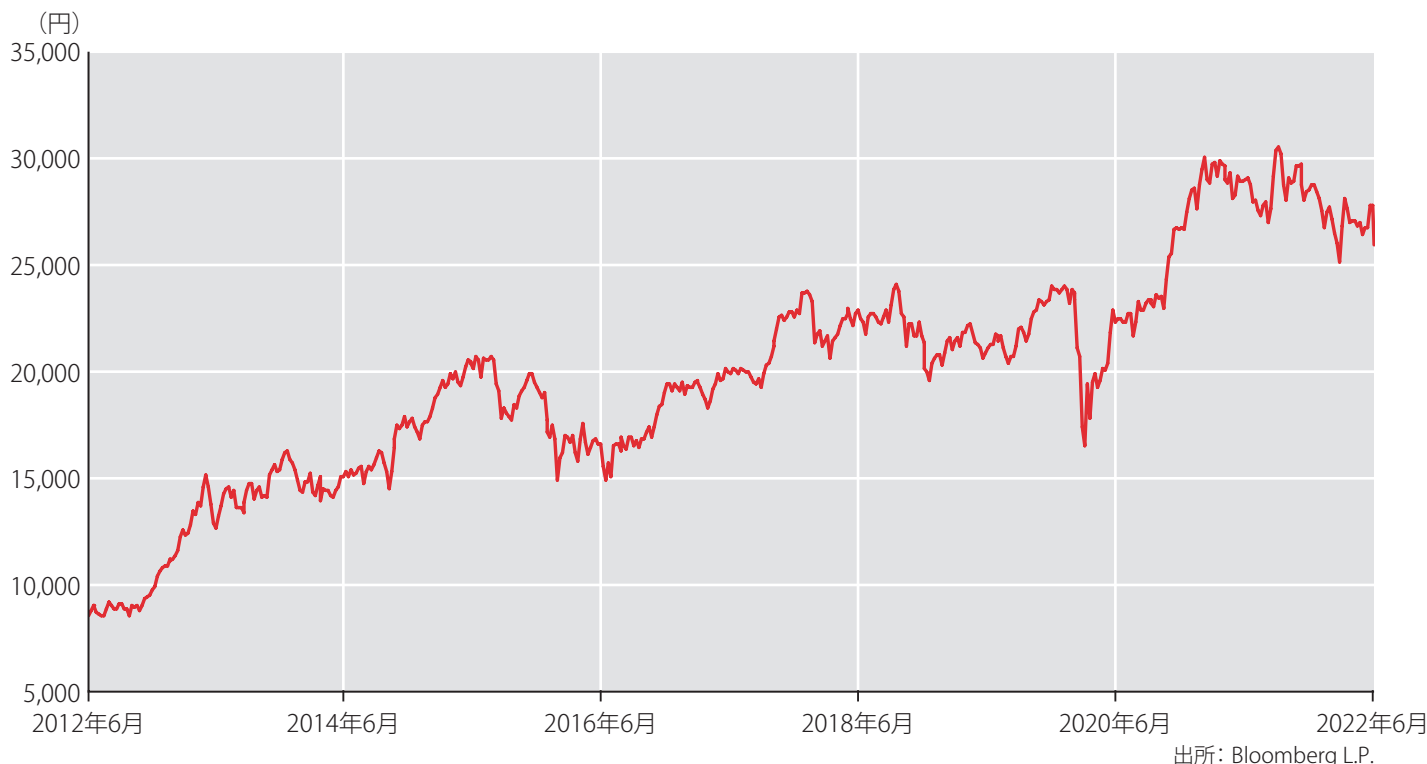
<最終評価価格と償還率>

～日経平均株価（観察期間中のもので、ゼラ場を含む）が、一度でもノックイン価格以下になった場合～
〔仮定条件〕当初価格25,900円



参照指数について

<日経平均株価終値の推移>



※「日経平均株価」(日経平均)に関する著作権、知的所有権その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は本商品を保証するものではなく、本商品について一切の責任を負いません。

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(MUFJG)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MUFJG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 MUFJGグループの一員として」(2022年6月27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

- 対象株価指数が観察期間中にノックイン価格以下となった場合、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、対象株価指数の下落、市場金利の上昇、対象株価指数の予想変動率の上昇等により、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(2022年6月20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。

対象金融指標等

- 日経平均株価

試算の前提となるヒストリカルデータ

- 【対象株価指数の最大下落率】

対象株価指数	最大下落率※	観測期間	
		開始日	終了日
日経平均株価	63%	1990年4月1日	2022年5月31日

※観測期間における、各取引日を起算日とした3年間の期中下落率のうち、最大のもの

(出所：Bloomberg L.P.)

満期償還時の想定損失額

- 対象株価指数である日経平均株価が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	63%
-------------	-----

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] ・ 利率 2.70%

・ 観察期間中に対象株価指数が一度でもノックイン価格以下となる

額面に対する想定損失額	55%
-------------	-----

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さま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。
- 個人のお客さまの場合、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