

2021 年 12 月 29 日

社債権者 御中

(発行会社)
東京都千代田区大手町二丁目 2 番 2 号
野村信託銀行株式会社

野村信託銀行株式会社第 196 回無担保信託社債に関するお知らせ

野村信託銀行株式会社第 196 回無担保信託社債（責任財産限定特約付・適格機関投資家限定）（以下「本社債」といい、本社債の社債要項を以下「本社債要項」といいます。）につきまして、金利指標変更事由の発生に伴い、本信託（本信託契約に基づく信託をいいます。）の受益者の指図に従い、本件スワップ契約において参照する変動金利に係る金利指標を変更いたしました。

本社債の条件につきましても、本社債要項別紙 1 第 6 号但し書きの規定が適用され、2022 年 8 月以降の各利払期日において参照する適用利率に係る円 LIBOR は、本社債の利息計算期間と同一の期間において本件スワップ契約に基づき適用されるレートとなりますので、下記のとおり通知いたします（以下「本通知書」といいます。）。

なお、本通知書における用語は、本通知書において特に定める場合及び文脈上別義であることが明白である場合を除き、本社債要項において定める意味を有するものとします。

以上

記

本社債要項別紙1第6号但し書きの規定が適用される場合、関連する各規定は、以下のよう
に解釈されます。

12 本信託社債の利率

以下の算式により算出される利率（年率）（以下「適用利率」という。）とする。

2022年2月10日（但し、当該日が営業日でない場合はその翌営業日とする。）（同日
を含む。）までの利息計算期間

$$1.50\% \geq 6 \text{ ヶ月円 LIBOR} + 1.23\% \geq 0.00\%$$

2022年2月10日（但し、当該日が営業日でない場合はその翌営業日とする。）の翌日
（同日を含む。）以降の利息計算期間

$$1.50\% \geq 6 \text{ ヶ月円 LIBOR 代替利率} + 1.23\% \geq 0.00\%$$

※ 金利参照期間とは、各利息計算期間について、前利払期日の10営業日前の日（同
日を含む。）から当該利払期日の10営業日前の日（同日を含まない。）までの期
間をいう。

※ 代替参照レート調整値とは、0.05809%をいう。

※ 調整後日次累積複利レート（TONA）とは、日次累積複利レート（TONA）に360/365
を乗じた値（%の小数第6位を四捨五入する。）をいう。

※ TONA とは、無担保コールオーバーナイト（0/N）物レートをいう。

※ 日次累積複利レート（TONA）とは、各金利参照期間に属する各営業日の TONA（又
はその後継指標）としてその翌営業日において日本銀行（又はそのレートの管理
を承継するその他の者）が公表する確報値を参照する手法を用いて算出される当
該金利参照期間における TONA の日次累積複利（金利参照期間に属する各休業日（営
業日以外の日をいう。）についてはその前営業日の TONA の確報値を複利計算せず
に適用する。また、いずれかの営業日について TONA の確報値が公表されなかった
場合、直近で公表された TONA の確報値を当該営業日の TONA とみなす。）の値を、
当該金利参照期間に含まれる暦日数で除し、365 を乗じて計算される利率（%）を
いう。

※ 6 ヶ月円 LIBOR 代替利率とは、調整後日次累積複利レート (TONA) + 代替参照レート調整値という。但し、本件スワップ取引における計算代理人 (Calculation Agent) が、その単独の裁量により、調整後日次累積複利レート (TONA) を決定できないと判断した場合、又は、監督当局等による推奨内容若しくは市場慣行を考慮した上で調整後日次累積複利レート (TONA) 及び/又は代替参照レート調整値の使用が適切でないと判断した場合は、当該計算代理人が誠実にかつ商業上合理的な方法で決定した、調整後日次累積複利レート (TONA) + 代替参照レート調整値に代替するものとして本件スワップ取引における金利を計算する際に使用するレートという。

以上