

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2023年11月7日

【会社名】 ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・ブイ  
(Nomura Europe Finance N.V.)

【代表者の役職氏名】 社長兼業務執行取締役  
(President & Managing Director)  
久保田 健太郎  
(Kentaro Kubota)

【本店の所在の場所】 オランダ王国 アムステルダム市1096HA  
アムステルプライン1 レンブラント・タワー19階  
(Rembrandt Tower 19th floor, Amstelplein 1, 1096HA Amsterdam,  
The Netherlands)

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 柴田 弘典

【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区大手町一丁目1番1号  
大手町パークビルディング  
アンダーソン・毛利・友常法律事務所外国法共同事業

【電話番号】 03-6775-1000

【事務連絡者氏名】 弁護士 安藤 紘人  
弁護士 森田 翔

【連絡場所】 東京都千代田区大手町一丁目1番1号  
大手町パークビルディング  
アンダーソン・毛利・友常法律事務所外国法共同事業

【電話番号】 03-6775-1107  
03-6775-1664

【届出の対象とした募集有価証券の種類】 有価証券信託受益証券

【届出の対象とした募集金額】 申込期間 (2023年11月4日から2024年12月3日まで)  
各本受益権 (以下に定義する。) ごとに、500億円を上限とする。  
\* なお、申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新される。

【安定操作に関する事項】 該当事項なし

【縦覧に供する場所】 株式会社東京証券取引所  
(東京都中央区日本橋兜町2番1号)

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2023年10月10日付で提出した有価証券届出書の記載事項のうち、2023年11月6日付でNEXT NOTES 東証マザーズ ETNに係る信託個別契約が変更されたことに伴い、関連する事項を訂正するため、さらに、添付書類である「信託個別契約11」を差し替えるため、本訂正届出書を提出するものであります。

## 2【訂正事項】

### 第一部 証券情報

#### 第1 募集要項

##### 1 預託証券及び有価証券信託受益証券の募集

#### 募集又は売出しに関する特別記載事項

### 第五部 提出会社の保証会社等の情報

#### 第3 指数等の情報

##### 2 当該指数等の推移

### 添付書類

#### 信託個別契約11

## 3【訂正箇所】

(注) 訂正箇所は、\_\_\_\_ 罫で示しております(なお、上記有価証券届出書において付されていた下線は、訂正箇所を明示するため、以下においては表示していません。)

また、差し替える添付書類を本訂正届出書に添付しております。

## 第一部【証券情報】

### 第1【募集要項】

#### 1【預託証券及び有価証券信託受益証券の募集】

< 訂正前 >

銘柄

( 中略 )

11	NEXT NOTES 東証マザーズETN(注5)	東証マザーズ指数連動債
----	--------------------------	-------------

( 中略 )

(注1) 以下、第1から第23までの受益証券発行信託に係る受益権を個別にまたは総称して「本受益権」という。また、各本受益権に係る信託を個別にまたは総称して「本信託」という。

(注2) 以下、各本受益権に係る本信託の信託財産である第1から第23までの受託有価証券を個別にまたは総称して「本外国指標連動証券」という。また、第5から第8までの受託有価証券を個別にまたは総称して「日経・JPX指数連動債」、第9および第10の受託有価証券を個別にまたは総称して「ダウ・ジョーンズ工業株価平均指数連動債」、第13および第14の受託有価証券を個別にまたは総称して「S&P指数(課税後配当込み)連動債」、第15および第16の受託有価証券を個別にまたは総称して「Nifty指数連動債」ということがある。

(注3) 本外国指標連動証券の元本その他の支払は、野村ホールディングス株式会社により保証される。

(注4) 本書の提出会社であるノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・バイは、第1から第23までの本受益権に係る有価証券届出書を2022年9月9日に関東財務局長に提出している。

(注5) NEXT NOTES 東証マザーズ ETNの連動対象となる指標である東証マザーズ指数が2023年11月6日付で東証グロース市場250指数に変更される予定であることに伴い、NEXT NOTES 東証マザーズETNは同日付でNEXT NOTES 東証グロース市場250 ETNに変更される予定である。

(中略)

<NEXT NOTES NYダウ・ダブル・ブル・ドルヘッジETN、NEXT NOTES NYダウ・ベア・ドルヘッジETNおよびNEXT NOTES 東証マザーズETNに関する情報>

本外国指標連動証券の概要

(中略)

2 償還および買入

(中略)

(c) 用語の定義

(中略)

「営業日」とは、

ダウ・ジョーンズ工業株価平均指数連動債の場合：

東京、ニューヨークおよびロンドンにおいて、商業銀行および外国為替市場が、支払の決済を行い、通常の業務（外国為替取引および外貨預金取引を含む。）を営んでいる日をいう。

東証マザーズ指数連動債の場合：

東京およびロンドンにおいて、商業銀行および外国為替市場が、支払の決済を行い、通常の業務（外国為替取引および外貨預金取引を含む。）を営んでいる日をいう。

「管理費用」とは、

ダウ・ジョーンズ工業株価平均指数連動債の場合：

0.80% (=0.008) をいう。

東証マザーズ指数連動債の場合：

0.50% (=0.005) をいう。

「関連取引所」とは、

ダウ・ジョーンズ工業株価平均指数連動債の場合：

計算代理人が、その単独かつ完全な裁量により、本外国指標連動証券に関して重要であると判断する、本指数または原指数に関連する先物取引またはオプション取引が行われる取引所または相場システムをいう。

東証マザーズ指数連動債の場合：

計算代理人が、その単独かつ完全な裁量により、本外国指標連動証券に関して重要であると判断する、本指数に関連する先物取引またはオプション取引が行われる取引所または相場システムをいう。

(中略)

「最終評価日」とは、

(中略)

東証マザーズ指数連動債の場合：

満期償還日の10営業日前の日をいう。ただし、償還価額を算出するために使用される東証マザーズ指数の決定にあたり、かかる日が予定取引所営業日でない場合、東証マザーズ指数は、障害日でない翌予定取引所営業日において情報配信ソースに表示される終値を用いて決定されるものとする。東証マザーズ指数が最終評価日の8予定取引所営業日後の日までに決定されない場合、計算代理人は、その単独かつ完全な裁量により決定した東証マザーズ指数を用いて、最終評価日における償還価額を決定するものとする。

「参照通貨」とは、

ダウ・ジョーンズ工業株価平均指数連動債の場合：

日本円および米ドルをいう。

東証マザーズ指数連動債の場合：

日本円をいう。

「市場混乱事由」とは、

(中略)

東証マザーズ指数連動債の場合：

取引障害または取引所障害で、計算代理人が重大であると判断するものが、評価時刻までの1時間の間のいずれかの時点で、発生もしくは存在していること、または早期終了をいう。

(中略)

「早期償還決定期間」

(中略)

とは、

東証マザーズ指数連動債の場合：

償還価額を算出するために使用される東証マザーズ指数を決定するにあたり、早期償還決定期間のいずれかの日が予定取引所営業日でないかまたは障害日の場合、計算代理人は、かかる日の直前に情報配信ソースに最後に表示された東証マザーズ指数を用いて、かかる日における償還価額を決定することができる(ただし、決定する必要はない。 )。

(中略)

「当初評価日」とは、

(中略)

東証マザーズ指数連動債の場合：

償還価額を算出するために使用される東証マザーズ指数の決定にあたり、かかる日が予定取引所営業日ではないかまたは障害日の場合、計算代理人は、その単独かつ完全な裁量により、かかる日の直前に情報配信ソースに最後に表示された東証マザーズ指数を用いて、当初評価日における償還価額を決定するものとする。

(中略)

「本指数」とは、

ダウ・ジョーンズ工業株価平均レバレッジ指数連動債の場合：

ダウ・ジョーンズ工業株価平均 レバレッジ (2倍) ・インデックス (円ヘッジ・プライスリターン) (DJIA PR JPY-Monthly Hedged Leveraged (x2) Index) をいい、かかる指数を本書において「ダウ・ジョーンズ工業株価平均レバレッジ指数」ということがある。

ダウ・ジョーンズ工業株価平均インバース指数連動債の場合：

ダウ・ジョーンズ工業株価平均 インバース (-1倍) ・インデックス (円ヘッジ・トータルリターン) (DJIA TR JPY-Monthly Hedged Inverse (x1) Index) をいい、かかる指数を本書において「ダウ・ジョーンズ工業株価平均インバース指数」ということがある。

東証マザーズ指数連動債の場合：

東証マザーズ指数 (Tokyo Stock Exchange Mothers Index) をいう。

「本取引所」とは、

ダウ・ジョーンズ工業株価平均指数連動債の場合：

ニューヨーク証券取引所およびナスダック株式市場をいい、その承継取引所を含むものとする。

東証マザーズ指数連動債の場合：

株式会社東京証券取引所をいい、その承継取引所を含むものとする。

(中略)

「 $IL_t$ 」または「償還価額」とは、

(中略)

東証マザーズ指数連動債の場合：

$$IL_t = IL_{t-1} \times \frac{(TSEMOTHR[t])}{(TSEMOTHR[t-1])} \times (1 - \text{管理費用} \times \frac{1}{365})$$

(中略)

「TSEMOTHR[t]」または  
「東証マザーズ指数」とは、

ブルームバーグの「TSEMOTHR Index」のページまたは計算代理人が決定する後継もしくは代替のページもしくは情報配信ソースに表示される、いずれかの日の東証マザーズ指数の終値をいう。

「TSEMOTHR[0]」とは、

当初評価日における東証マザーズ指数をいう。

(中略)

(d) 本指数の調整

(中略)

< 免責事項 >

(中略)

東証マザーズ指数連動債の場合：

( ) 東証マザーズ指数の数値および東証マザーズ指数に係る標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社 (以下本項において「J P X」という。) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証マザーズ指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証マザーズ指数に係る標章または商標に関するすべての権利は J P X が有する。

- ( ) J P X は、東証マザーズ指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証マザーズ指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証マザーズ指数に係る標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができる。
- ( ) J P X は、東証マザーズ指数の指数値および東証マザーズ指数に係る標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証マザーズ指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではない。
- ( ) J P X は、東証マザーズ指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また、J P X は、東証マザーズ指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負わない。
- ( ) NEXT NOTES 東証マザーズ ETNは、J P X により提供、保証または販売されるものではない。
- ( ) J P X は、NEXT NOTES 東証マザーズ ETNの購入者または公衆に対し、NEXT NOTES 東証マザーズ ETNの説明または投資のアドバイスをする義務を負わない。
- ( ) J P X は、当社またはNEXT NOTES 東証マザーズ ETNの購入者のニーズを東証マザーズ指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではない。
- ( ) 以上の項目に限らず、J P X はNEXT NOTES 東証マザーズ ETNの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しない。

( 中略 )

### 3 支払

( 中略 )

#### (b) 支払日

本外国指標連動証券に関する金員の支払期日が、支払日(以下に定義する。)以外の日にあたる場合には、当該本外国指標連動証券の所持人は当該場所における翌支払日まで支払を受けることができず、かつ、かかる支払の繰延に関して、追加利息その他の金員の支払を受けることができない。本号において、「支払日」とは、ダウ・ジョーンズ工業株価平均指数連動債の場合は、東京、ニューヨークおよびロンドンにおいて、商業銀行および外国為替市場が、支払の決済を行い、通常の業務(外国為替取引および外貨預金取引を含む。)を営んでいる日をいい、東証マザーズ指数連動債の場合は、東京およびロンドンにおいて、商業銀行および外国為替市場が、支払の決済を行い、通常の業務(外国為替取引および外貨預金取引を含む。)を営んでいる日をいう。

( 中略 )

#### **東証マザーズ指数**

東証マザーズ指数は、主にマザーズ市場に上場していた内国普通株式およびグロース市場に上場する内国普通株式を対象とする浮動株調整後時価総額加重型の株価指数である。基準日は2003年9月12日、基準値は1,000ポイントである。

東証マザーズ指数の算出に用いる浮動株比率は、後述のキャップ調整係数および移行係数考慮後の値を用いる。

個別銘柄のウェイト上限は20%である。キャップ調整に係るウェイト計算における基準日(以下本項において「ウェイト基準日」という。)における浮動株時価総額ウェイトが上限を超える銘柄については、10月最終営業日にキャップ調整係数を設定する。その後に株価の変動等により上限を超える場合も翌年の10月最終営業日までキャップ調整係数は変更しないものとする。

## 算出対象の追加・除外

- ・算出対象の定期入替は毎年1回(10月最終営業日)行われる。
- ・定期入替に係る基準日(以下本項において「定期入替基準日」という。)およびウエイト基準日は、毎年8月最終営業日とし、以下の手順により構成銘柄が決定される。

定期入替基準日時点における東証グロース市場指数の構成銘柄を母集団とする。

ただし、以下のいずれかに該当する銘柄は母集団から除外する。

定期入替基準日において、整理銘柄に指定されていること。

定期入替基準日において、特設注意市場銘柄に指定されていること。

定期入替基準日において、上場市場を変更することが公表されていること。

定期入替基準日において、TOPIX(東証株価指数)の構成銘柄に含まれていること。

母集団からの除外の条件は、原則として、定期入替基準日から定期入替結果の発表までの間に該当することが判明した銘柄を含む。

基準日における上場時価総額の大きい順に250銘柄を構成銘柄として選定する。ただし、母集団の総数が300を下回る場合、母集団の総数から50を減じた銘柄数を選定する。

## 2022年10月の定期入替の特例

- ・指標の継続性の観点から、2022年10月の定期入替の結果、除外となる銘柄については、段階的ウエイト低減銘柄とし、2022年10月最終営業日から四半期ごとの最終営業日に、3段階で構成比率を調整し、2023年4月最終営業日に除外する。
- ・段階的ウエイト低減銘柄は、浮動株比率に下記の移行係数を乗じて構成比率を調整する。

移行実施回	指数修正日	移行係数
1回目	2022年10月最終営業日	×0.67
2回目	2023年1月最終営業日	×0.33
3回目	2023年4月最終営業日	×0

## 投資者の判断に重要な影響を及ぼす可能性のある事項

## 本受益権または本外国指標連動証券に関するリスク要因

本受益権の信託財産である本外国指標連動証券は、発行会社の担保の裏付けがない証券であり、担保付債務ではない。また本外国指標連動証券および/または本受益権のリターンは、各本外国指標連動証券および/または各本受益権の連動指標であるダウ・ジョーンズ工業株価平均 レバレッジ(2倍)・インデックス(円ヘッジ)、ダウ・ジョーンズ工業株価平均 インパース(-1倍)・インデックス(円ヘッジ)および東証マザーズ指数(以下個別にまたは総称して「本指数」または「連動先指数」という。)のパフォーマンスに連動している。本外国指標連動証券および/または本受益権に投資することは、連動先指数の構成銘柄に直接投資することと同じではない。

(後略)

<訂正後>

銘柄

(中略)

11	NEXT NOTES 東証グロース市場250 ETN	東証グロース市場250指数連動債
----	----------------------------	------------------

( 中略 )

- (注1) 以下、第1から第23までの受益証券発行信託に係る受益権を個別にまたは総称して「本受益権」という。また、各本受益権に係る信託を個別にまたは総称して「本信託」という。
- (注2) 以下、各本受益権に係る本信託の信託財産である第1から第23までの受託有価証券を個別にまたは総称して「本外国指標連動証券」という。また、第5から第8までの受託有価証券を個別にまたは総称して「日経・JPX指数連動債」、第9および第10の受託有価証券を個別にまたは総称して「ダウ・ジョーンズ工業株価平均指数連動債」、第13および第14の受託有価証券を個別にまたは総称して「S&P指数(課税後配当込み)連動債」、第15および第16の受託有価証券を個別にまたは総称して「Nifty指数連動債」ということがある。
- (注3) 本外国指標連動証券の元本その他の支払は、野村ホールディングス株式会社により保証される。
- (注4) 本書の提出会社であるノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・ブイは、第1から第23までの本受益権に係る有価証券届出書を2022年9月9日に関東財務局長に提出している。

( 中略 )

< NEXT NOTES NYダウ・ダブル・ブル・ドルヘッジETN、NEXT NOTES NYダウ・ベア・ドルヘッジETNおよびNEXT NOTES 東証グロース市場250 ETNに関する情報 >

本外国指標連動証券の概要

( 中略 )

## 2 償還および買入

( 中略 )

### (c) 用語の定義

( 中略 )

「営業日」とは、

ダウ・ジョーンズ工業株価平均指数連動債の場合：

東京、ニューヨークおよびロンドンにおいて、商業銀行および外国為替市場が、支払の決済を行い、通常の業務（外国為替取引および外貨預金取引を含む。）を営んでいる日をいう。

東証グロース市場250指数連動債の場合：

東京およびロンドンにおいて、商業銀行および外国為替市場が、支払の決済を行い、通常の業務（外国為替取引および外貨預金取引を含む。）を営んでいる日をいう。

「管理費用」とは、

ダウ・ジョーンズ工業株価平均指数連動債の場合：

0.80% (=0.008) をいう。

東証グロース市場250指数連動債の場合：

0.50% (=0.005) をいう。

「関連取引所」とは、

ダウ・ジョーンズ工業株価平均指数連動債の場合：

計算代理人が、その単独かつ完全な裁量により、本外国指標連動証券に関して重要であると判断する、本指数または原指数に関連する先物取引またはオプション取引が行われる取引所または相場システムをいう。

東証グロース市場250指数連動債の場合：

計算代理人が、その単独かつ完全な裁量により、本外国指標連動証券に関して重要であると判断する、本指数に関連する先物取引またはオプション取引が行われる取引所または相場システムをいう。

( 中略 )

「最終評価日」とは、

( 中略 )

東証グロース市場250指数連動債の場合：

満期償還日の10営業日前の日をいう。ただし、償還価額を算出するために使用される東証グロース市場250指数の決定にあたり、かかる日が予定取引所営業日でない場合、東証グロース市場250指数は、障害日でない翌予定取引所営業日において情報配信ソースに表示される終値を用いて決定されるものとする。東証グロース市場250指数が最終評価日の8 予定取引所営業日後の日までに決定されない場合、計算代理人は、その単独かつ完全な裁量により決定した東証グロース市場250指数を用いて、最終評価日における償還価額を決定するものとする。

「参照通貨」とは、

ダウ・ジョーンズ工業株価平均指数連動債の場合：

日本円および米ドルをいう。

東証グロース市場250指数連動債の場合：

日本円をいう。

「市場混乱事由」とは、

( 中略 )

東証グロース市場250指数連動債の場合：

取引障害または取引所障害で、計算代理人が重大であると判断するものが、評価時刻までの1時間の間のいずれかの時点で、発生もしくは存在していること、または早期終了をいう。

( 中略 )

「早期償還決定期間」

( 中略 )

とは、

東証グロース市場250指数連動債の場合：

償還価額を算出するために使用される東証グロース市場250指数を決定するにあたり、早期償還決定期間のいずれかの日が予定取引所営業日でないかまたは障害日の場合、計算代理人は、かかる日の直前に情報配信ソースに最後に表示された東証グロース市場250指数を用いて、かかる日における償還価額を決定することができる(ただし、決定する必要はない。 )。

( 中略 )

「当初評価日」とは、

( 中略 )

東証グロース市場250指数連動債の場合：

償還価額を算出するために使用される東証グロース市場250指数の決定にあたり、かかる日が予定取引所営業日ではないかまたは障害日の場合、計算代理人は、その単独かつ完全な裁量により、かかる日の直前に情報配信ソースに最後に表示された東証グロース市場250指数を用いて、当初評価日における償還価額を決定するものとする。

(中略)

「本指数」とは、

ダウ・ジョーンズ工業株価平均レバレッジ指数連動債の場合：

ダウ・ジョーンズ工業株価平均 レバレッジ (2倍) ・インデックス (円ヘッジ・ブライスリターン) (DJIA PR JPY-Monthly Hedged Leveraged (x2) Index) をいい、かかる指数を本書において「ダウ・ジョーンズ工業株価平均レバレッジ指数」ということがある。

ダウ・ジョーンズ工業株価平均インバース指数連動債の場合：

ダウ・ジョーンズ工業株価平均 インバース (-1倍) ・インデックス (円ヘッジ・トータルリターン) (DJIA TR JPY-Monthly Hedged Inverse (x1) Index) をいい、かかる指数を本書において「ダウ・ジョーンズ工業株価平均インバース指数」ということがある。

東証グロース市場250指数連動債の場合：

東証グロース市場250指数 (Tokyo Stock Exchange Growth Market 250 Index) をいう。

「本取引所」とは、

ダウ・ジョーンズ工業株価平均指数連動債の場合：

ニューヨーク証券取引所およびナスダック株式市場をいい、その承継取引所を含むものとする。

東証グロース市場250指数連動債の場合：

株式会社東京証券取引所をいい、その承継取引所を含むものとする。

(中略)

「 $IL_t$ 」または「償還価額」とは、

(中略)

東証グロース市場250指数連動債の場合：

$$IL_t = IL_{t-1} \times \frac{(TSEMOTHR[t])}{(TSEMOTHR[t-1])} \times (1 - \text{管理費用} \times \frac{1}{365})$$

(中略)

「TSEMOTHR[t]」または

「東証グロース市場250指数」とは、

「TSEMOTHR[0]」とは、

ブルームバーグの「TSEMOTHR Index」のページまたは計算代理人が決定する後継もしくは代替のページもしくは情報配信ソースに表示される、いずれかの日の東証グロース市場250指数の終値をいう。

当初評価日における東証グロース市場250指数をいう。

(中略)

(d) 本指数の調整

(中略)

< 免責事項 >

(中略)

東証グロース市場250指数連動債の場合：

- ( ) 東証グロース市場250指数の指数値および東証グロース市場250指数に係る標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社(以下本項において「J P X」と総称する。)の知的財産であり、東証グロース市場250指数の指数値の算出、公表および利用など東証グロース市場250指数に関するすべての権利・ノウハウならびに東証グロース市場250指数に係る標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有する。
- ( ) J P Xは、東証グロース市場250指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証グロース市場250指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証グロース市場250指数に係る標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができる。
- ( ) J P Xは、東証グロース市場250指数の指数値および東証グロース市場250指数に係る標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証グロース市場250指数の指数値について、何ら保証または表明をするものではない。
- ( ) J P Xは、東証グロース市場250指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性または完全性を保証するものではない。また、J P Xは、東証グロース市場250指数の指数値の算出の誤謬、公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負わない。
- ( ) 東証グロース市場250指数の指数値に関連する金融商品は、J P Xにより提供、保証または販売されるものではない。
- ( ) J P Xは、東証グロース市場250指数の指数値に関連する金融商品の購入者または公衆に対し、東証グロース市場250指数の指数値に関連する金融商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負わない。
- ( ) J P Xは、特定の銘柄または銘柄群を選定したり、当社または東証グロース市場250指数の指数値に関連する金融商品の購入者のニーズを東証グロース市場250指数の指数値の計算に考慮したりするものではない。
- ( ) 以上の項目を含むがこれらに限らず、J P Xは東証グロース市場250指数の指数値に関連する金融商品の発行および販売に起因するいかなる損害に対しても責任を有しない。

(中略)

### 3 支払

(中略)

#### (b) 支払日

本外国指標連動証券に関する金員の支払期日が、支払日(以下に定義する。)以外の日にあたる場合には、当該本外国指標連動証券の所持人は当該場所における翌支払日まで支払を受けることができず、かつ、かかる支払の繰延に関して、追加利息その他の金員の支払を受けることができない。本号において、「支払日」とは、ダウ・ジョーンズ工業株価平均指数連動債の場合は、東京、ニューヨークおよびロンドンにおいて、商業銀行および外国為替市場が、支払の決済を行い、通常の業務(外国為替取引および外貨預金取引を含む。)を営んでいる日をいい、東証グロース市場250指数連動債の場合は、東京およびロンドンにおいて、商業銀行および外国為替市場が、支払の決済を行い、通常の業務(外国為替取引および外貨預金取引を含む。)を営んでいる日をいう。

(中略)

## 東証グロース市場250指数

東証グロース市場250指数は、東証グロース市場指数の算出対象を母集団とし、上場時価総額を基準としてJ P X 総研が選定した銘柄を算出対象とする浮動株調整後時価総額加重型の株価指数である。基準日は2003年9月12日、基準値は1,000ポイントである。

東証グロース市場250指数の算出に用いる浮動株比率は、後述のキャップ調整係数および移行係数考慮後の値を用いる。

個別銘柄のウエイト上限は20%である。キャップ調整に係るウエイト計算における基準日(以下本項において「ウエイト基準日」という。)における浮動株時価総額ウエイトが上限を超える銘柄については、10月最終営業日にキャップ調整係数を設定する。その後に株価の変動等により上限を超える場合も翌年の10月最終営業日までキャップ調整係数は変更しないものとする。

### 算出対象の追加・除外

- ・算出対象の定期入替は毎年1回(10月最終営業日)行われる。
- ・定期入替に係る基準日(以下本項において「定期入替基準日」という。)およびウエイト基準日は、毎年8月最終営業日とし、以下の手順により構成銘柄が決定される。

定期入替基準日時点における東証グロース市場指数の構成銘柄を母集団とする。

ただし、以下のいずれかに該当する銘柄は母集団から除外する。

定期入替基準日において、整理銘柄に指定されていること。

定期入替基準日において、特設注意市場銘柄に指定されていること。

定期入替基準日において、上場市場を変更することが公表されていること。

定期入替基準日において、TOPIX(東証株価指数)の構成銘柄に含まれていること。

母集団からの除外の条件は、原則として、定期入替基準日から定期入替結果の発表までの間に該当することが判明した銘柄を含む。

基準日における上場時価総額の大きい順に250銘柄を構成銘柄として選定する。ただし、母集団の総数が300を下回る場合、母集団の総数から50を減じた銘柄数を選定する。

### 投資者の判断に重要な影響を及ぼす可能性のある事項

#### 本受益権または本外国指標連動証券に関するリスク要因

本受益権の信託財産である本外国指標連動証券は、発行会社の担保の裏付けがない証券であり、担保付債務ではない。また本外国指標連動証券および/または本受益権のリターンは、各本外国指標連動証券および/または各本受益権の連動指標であるダウ・ジョーンズ工業株価平均 レバレッジ(2倍)・インデックス(円ヘッジ)、ダウ・ジョーンズ工業株価平均 インバース(-1倍)・インデックス(円ヘッジ)および東証グロース市場250指数(以下個別にまたは総称して「本指数」または「連動先指数」という。)のパフォーマンスに連動している。本外国指標連動証券および/または本受益権に投資することは、連動先指数の構成銘柄に直接投資することと同じではない。

(後略)

#### 【募集又は売出しに関する特別記載事項】

<訂正前>

(前略)

## &lt;NEXT NOTES 東証マザーズ ETNに関する情報&gt;

銘柄名	NEXT NOTES 東証マザーズ ETN (銘柄コード: 2042)
連動対象となる指標	東証マザーズ指数
連動対象となる指標の概要	連動対象となる指標は、主にマザーズ市場に上場していた内国普通株式およびグロース市場に上場する内国普通株式を対象とする浮動株調整後時価総額加重型の株価指数です。(なお、指数構成銘柄は段階的に見直しが行われ、2023年4月末時点では、東証グロース市場指数構成銘柄のうち時価総額上位250銘柄が採用される予定です。)その値動きはNEXT NOTES ウェブサイト ( <a href="https://nextnotes.com/">https://nextnotes.com/</a> (またはその承継URL)) をご参照下さい。

(後略)

## &lt;訂正後&gt;

(前略)

## &lt;NEXT NOTES 東証グロース市場250 ETNに関する情報&gt;

銘柄名	NEXT NOTES 東証グロース市場250 ETN (銘柄コード: 2042)
連動対象となる指標	東証グロース市場250指数
連動対象となる指標の概要	連動対象となる指標は、東証グロース市場指数の算出対象を母集団とし、上場時価総額を基準としてJPX総研が選定した銘柄を算出対象とする時価総額加重型の株価指数です。その値動きはNEXT NOTES ウェブサイト ( <a href="https://nextnotes.com/">https://nextnotes.com/</a> (またはその承継URL)) をご参照下さい。

(後略)

## 第五部【提出会社の保証会社等の情報】

## 第3【指数等の情報】

## 2【当該指数等の推移】

## &lt;訂正前&gt;

(前略)

## (11) 東証マザーズ指数の過去の推移

最近5年間の 年別最高・最低値	年	2018年	2019年	2020年	2021年	2022年	
	最高	1,355.55	967.92	1,365.49	1,320.73	976.74	
	最低	757.02	824.20	557.86	948.28	615.35	
最近6ヶ月の 月別最高・最低値	年	2023年 4月	2023年 5月	2023年 6月	2023年 7月	2023年 8月	2023年 9月
	最高	766.20	760.64	864.77	818.68	780.62	768.79
	最低	730.43	725.69	747.48	764.04	714.39	712.52

出所：野村證券作成

(後略)

&lt;訂正後&gt;

(前略)

## (11) 東証グロース市場250指数の過去の推移

最近5年間の 年別最高・最低値	年	2018年	2019年	2020年	2021年	2022年	
	最高	1,355.55	967.92	1,365.49	1,320.73	976.74	
	最低	757.02	824.20	557.86	948.28	615.35	
最近6ヶ月の 月別最高・最低値	年	2023年 4月	2023年 5月	2023年 6月	2023年 7月	2023年 8月	2023年 9月
	最高	766.20	760.64	864.77	818.68	780.62	768.79
	最低	730.43	725.69	747.48	764.04	714.39	712.52

出所：野村證券作成

(後略)