【表紙】

【発行登録追補書類番号】 29－外１－29

【提出書類】 発行登録追補書類

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成30年８月16日

【会社名】 モルガン・スタンレー・ファイナンス・エルエルシー
(Morgan Stanley Finance LLC)

【代表者の役職氏名】 秘書役
(Secretary)
アーロン・ペイジ
(Aaron Page)

【本店の所在の場所】 アメリカ合衆国 10036 ニューヨーク州
ニューヨーク、ブロードウェイ1585
(1585 Broadway, New York, New York
10036, U.S.A.)

【代理人の氏名又は名称】 弁　護　士　　庭　野　　議　隆

【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

【電話番号】 (03)6775-1000

【事務連絡者氏名】 弁　護　士　　塩　見　竜　一
同　　関　　彩　香
同　　先　山　雅　規
同　　山　田　智　己
同　　中　林　憲　一

【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

【電話番号】 (03)6775-1000

【発行登録の対象とした売出有価証券の種類】 社債

【今回の売出金額】 1,538,000,000円

【発行登録書の内容】

提出日	平成29年８月14日
効力発生日	平成29年８月22日
有効期限	平成31年８月21日
発行登録番号	29－外１
発行予定額又は発行残高の上限	発行予定額　7,800億円

【これまでの売出実績】
（発行予定額を記載した場合）

番号	提出年月日	売出金額	減額による訂正年月日	減額金額

29-外１-１	平成29年９月13日	3,950,000,000円	該当事項なし	該当事項なし
29-外１-２	平成29年９月13日	1,503,000,000円		
29-外１-３	平成29年９月20日	796,000,000円		
29-外１-４	平成29年９月20日	1,577,000,000円		
29-外１-５	平成29年10月27日	464,000,000円		
29-外１-６	平成29年10月27日	1,218,000,000円		
29-外１-７	平成29年11月１日	18,329,000,000円		
29-外１-８	平成29年11月16日	20,925,000,000円		
29-外１-９	平成29年11月16日	9,049,000,000円		
29-外１-10	平成29年11月24日	743,000,000円		
29-外１-11	平成29年11月24日	983,000,000円		
29-外１-12	平成29年12月11日	31,730,000,000円		
29-外１-13	平成29年12月12日	14,635,000,000円		
29-外１-14	平成30年１月31日	8,352,000,000円		
29-外１-15	平成30年２月16日	22,359,000,000円		
29-外１-16	平成30年２月16日	11,618,000,000円		
29-外１-17	平成30年２月26日	690,000,000円		
29-外１-18	平成30年２月26日	687,000,000円		
29-外１-19	平成30年３月20日	7,647,000,000円		
29-外１-20	平成30年３月20日	3,046,000,000円		
29-外１-21	平成30年４月26日	326,000,000円		
29-外１-22	平成30年４月26日	685,000,000円		
29-外１-23	平成30年５月17日	3,879,000,000円		
29-外１-24	平成30年５月17日	961,000,000円		
29-外１-25	平成30年５月28日	662,000,000円		
29-外１-26	平成30年６月18日	3,155,000,000		
29-外１-27	平成30年６月18日	1,275,000,000		
29-外１-28	平成30年６月21日	175,000,000		
実績合計額		171,419,000,000円	減額総額	０円

【残額】(発行予定額－実績合計額－減額総額) 608,581,000,000円

(発行残高の上限を記載した場合)

番号	提出年月日	売出金額	償還年月日	償還金額	減額による訂正年月日	減額金額
該当事項なし						
実績合計額		該当事項なし	償還総額	該当事項なし	減額総額	該当事項なし

【残高】　該当事項なし

【安定操作に関する事項】　該当事項なし

【縦覧に供する場所】　該当事項なし

第一部【証券情報】

[モルガン・スタンレー保証付 モルガン・スタンレー・ファイナンス・エルエルシー 2023年８月９日満期 期限前償還条項付 日経平均株価・S&P500 複数株価指数連動デジタルクーポン 円建社債に関する情報]

第１【募集要項】

該当事項なし

第２【売出要項】

１【売出有価証券】

（１）【売出社債（短期社債を除く。）】

売出券面額の総額又は 売出振替社債の総額	1,538,000,000円
売出価額の総額	1,538,000,000円
利率	（ｉ）2018年８月24日（同日を含む。）から2018年11月９日（同日を含まない。）までの初回利息期間：年2.60% （ii）2018年11月９日（同日を含む。）から満期日（同日を含まない。）までの各利息期間： (a) すべての対象株価指数の評価価格が関連する基準価格以上の場合 年2.60% (b) いずれかまたはすべての対象株価指数の評価価格が関連する基準価格未満の場合 年0.10%

２【売出しの条件】

３．利息

3.1 利息の発生

本社債は、2018年８月24日（「利息開始日」）以降利息を生じ、当該利息は社債要項第５項（支払）の定めに従い、2018年11月９日（「初回利払日」）以降満期日（いずれも同日を含む。）までの各年の２月９日、５月９日、８月９日および11月９日（「利払日」）において後払で支払われる。ただし、期限前償還事由（社債要項4.1(2)において定義される。）が発生した場合の最終利払日は、期限前償還日（社債要項4.1(2)において定義される。）とする。

本項において、

「評価日」とは、各利払日（営業日規則に基づく調整後）の10共通取引所営業日前の日をいう。ただし、社債要項第３項に従うものとする。評価日がいずれかの対象株価指数につき障害日に当たる場合、障害日の発生の影響を受けない対象株価指数の評価日は、当初予定されていた評価日とし、障害日の発生により影響を受けた対象株価指数の評価日は障害日に当たらない翌取引所営業日とする。ただし、評価日直後の３取引所営業日がいずれも障害日に当たる場合は除き、そのような場合は、(1)かかる３日目の取引所営業日が障害日であるという事実にかかわらず評価日とみなされ、かつ(2)決定代理人は、その単独かつ絶対的な裁量で、かかる３日目の取引所営業日の決定時刻現在における対象株価指数の水準を、初回の障害日の発生前に直近で有効であった当該対象株価指数の計算式および計算方法に従い、当該対象株価指数を構成する各有価証券その他の資産につき、かかる３日目の取引所営業日の決定時刻現在において本取引所で取引または建値が行われた価格（障害日の発生事由がかかる３日目の取引所営業日に当該有価証券に関して発生した場合は、かかる３日目の取引所営業日の決定時刻現在における当該有価証券の誠実な見積価額）を用いて決定する。

「共通取引所営業日」とは、すべての対象株価指数について取引所営業日である日をいう。

「評価価格」とは、各対象株価指数に関して、評価日における当該対象株価指数の終値をいう。

「最終評価日」とは、満期日（営業日規則に基づく調整後）の直前に到来する予定の評価日をいう。最終評価日が障害日である場合は、上記の評価日の調整規定が準用され、最終評価日は調整される。

なお、ある特定の利息期間中に到来する期限前償還判定日（社債要項4.1(2)において定義される。）に期限前償還事由が発生した場合、当該利息期間を最終利息期間とし、当該利息期間の最終日に到来する利払日を最終利払日とする。

利息開始日（同日を含む。）から満期日（同日を含まない。）までの各利息期間（社債要項第3.2項(5)において定義される。）の利率は、決定代理人により、以下の通り決定される。

2018年８月24日（同日を含む。）から2018年11月９日（同日を含まない。）までの初回利息期間についてのみ、利率は年2.60%とする。これにより、当該利息期間が終了する初回利払日に各本社債について5,417円の利息額が支払われる。

2018年11月９日（同日を含む。）から満期日（同日を含まない。）までの各利息期間について、（ⅰ）関連する評価日におけるすべての対象株価指数の評価価格がそれぞれの基準価格以上である場合、当該利払日（当日を含まない。）に終了する利息期間に適用される利率は年2.60%となる。これにより、当該利息期間が終了する利払日に各本社債について6,500円の利息額が支払われる。または、（ⅱ）関連する評価日におけるいずれかまたはすべての対象株価指数の評価価格が関連する基準価格未満である場合、当該利払日（当日を含まない。）に終了する利息期間に適用される利率は年0.10%となる。これにより、当該利息期間が終了する利払日に各本社債について250円の利息額が支払われる。

「基準価格」とは、各対象株価指数に関して、当初価格の50%に相当する価格をいう。ただし、小数第３位以下を四捨五入する。

「当初価格」とは、各対象株価指数に関して、決定代理人が決定する、条件設定日における（決定時刻現在の）当該対象株価指数の終値をいう。

「条件設定日」とは、2018年８月24日をいい、当該日が障害日にあたる場合は、社債要項第３項に従った評価日に関する調整に服する。

「最終償還金額」とは、本社債に関して、社債要項4.1(1)に従って決定される最終償還金額をいう。

本社債はいずれも、最終償還期日以降は利息を生じない。ただし、かかる期日において償還金の支払が不適切に留保または拒絶された場合は、社債要項第３項に従い、(ⅰ)当該本社債につき支払期の到来した金員の全額が該当する社債権者により、または社債権者のために受領された日、または(ⅱ)当該本社債につき支払期の到来した金員の全額（社債権者に対する通知から７日後の日までに支払期が到来するものを含む。）を受領した旨財務代理人が社債権者に通知した日から７日後の日（その後支払に不履行が生じた場合を除く。）のうちいずれか早期まで、（判決後においても判決前と同様に）引き続き利息を生ずる。

第３【第三者割当の場合の特記事項】

該当事項なし。

第４【その他の記載事項】

下記の文言が発行登録追補目論見書の一部を構成することになる「発行登録追補書類に記載の事項」と題する書面に印刷されます。

「本書ならびに本社債に関する2018年８月付発行登録目論見書をもって本社債の発行登録追補目論見書としますので、これらの内容を合わせてご覧下さい。ただし、本書では平成30年７月31日付訂正発行登録書および平成30年８月16日付発行登録追補書類に記載された情報のうち、同発行登録目論見書に既に記載されたものについては、一部を省略しています。」

第二部【公開買付けに関する情報】

第１【公開買付けの概要】

該当事項なし。

第２【統合財務情報】

該当事項なし。

第３【発行者（その関連者）と対象者との重要な契約】

該当事項なし。

第三部【参照情報】

第１【参照書類】

会社の概況及び事業の概況等金融商品取引法（昭和23年法律第25号、その後の改正を含む。）第５条第１項第２号に掲げる事項については、以下に掲げる書類を参照すること。

１【有価証券報告書及びその添付書類】
事業年度　2017年度（自2017年１月１日　至2017年12月31日）平成30年６月29日
関東財務局長に提出

２【四半期報告書又は半期報告書】
該当事項なし。

３【臨時報告書】
該当事項なし。

４【外国会社報告書及びその補足書類】
該当事項なし。

５【外国会社四半期報告書及びその補足書類並びに外国会社半期報告書及びその補足書類】
該当事項なし。

６【外国会社臨時報告書】
該当事項なし。

７【訂正報告書】
該当事項なし。

第２【参照書類の補完情報】

上記に掲げた参照書類としての有価証券報告書に記載の「事業等のリスク」については、発行登録書（訂正を含む。）の「参照書類の補完情報」に記載された事項を除き、当該有価証券報告書の提出日以後、本発行登録追補書類提出日（平成30年８月16日）までの間において重大な変更は生じておらず、また追加で記載すべき事項も生じていない。

また、当該有価証券報告書および発行登録書（訂正を含む。）には将来に関する事項が記載されているが、当該事項は本発行登録追補書類提出日（平成30年８月16日）現在においてもその判断に重要な変更はなく、新たに記載する将来に関する事項もない。

第３【参照書類を縦覧に供している場所】

該当事項なし。

第四部【保証会社等の情報】

第１【保証会社情報】

１【保証の対象となっている社債】

社債の名称：　モルガン・スタンレー保証付 モルガン・スタンレー・ファイナンス・エルエルシー 2023年８月９日満期 期限前償還条項付 日経平均株価・S&P500 複数株価指数連動デジタルクーポン 円建社債

発行年月：2018年８月23日

券面総額又は振替社債の総額：1,538,000,000円

償還額：該当なし

提出会社の最近事業年度末日の未償還額：該当なし

上場金融商品取引所または登録認可金融商品取引業協会名：該当なし