

【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】 2021年12月23日

【会社名】 ノムラ・ヨーロッパ・ファイナンス・エヌ・バイ
(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 小塚 満里鈴

【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
03-6775-1551

【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（2021年9月4日から2022年10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】

2021年8月19日付で提出した有価証券届出書（訂正を含む。）の記載事項について、訂正すべき事項があり、また、2021年12月22日に当社が半期報告書を提出したことに伴い、関連する事項を訂正するため、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

第三部 追完情報

1 事業等のリスク

第四部 組込情報

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おりません。）。

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>

（前略）

<NEXT NOTES 香港ハンセン・ダブル・ブル ETN、NEXT NOTES 香港ハンセン・ベア ETN、NEXT NOTES 韓国KOSPI・ダブル・ブル ETNおよびNEXT NOTES 韓国KOSPI・ベア ETNに関する情報>

（中略）

韓国総合株価指数200・レバレッジインデックスの計算方法

$$L(T) = L(T-1) \times [1 + \{K \times (\underline{F}(T)/\underline{F}(T-1) - 1) - (K-1) \times (r/365) \times D(T, T-1)\}]$$

L(T)：指数計算時点(T)における韓国総合株価指数200・レバレッジインデックス値

L(T-1)：指数計算時点(T)の前日における韓国総合株価指数200・レバレッジインデックス値

K：2

D(T, T-1)：TからT-1までの実日数

r：91日満期CDの金利（% 年率）

$\underline{F}(T)$ ：現在の韓国総合株価指数200指数値

$\underline{F}(T-1)$ ：前日の韓国総合株価指数200指数終値

韓国総合株価指数200 (先物) ・インバースインデックスの計算方法

$$I(T) = I(T-1) \times [1 + \{-K \times (F(T)/F(T-1) - 1) + (K \times 0.85) \times (r/365) \times D(T, T-1)\}]$$

I(T): 指数計算時点(T)における韓国総合株価指数200 (先物) ・インバースインデックス値

I(T-1) : 指数計算時点(T)の前日における韓国総合株価指数200 (先物) ・インバースインデックス値

K: 1

D(T, T-1): TからT-1までの実日数

r: 91日満期CDの金利 (% 年率)

F(T): 現在の韓国総合株価指数200 (先物) 指数値

F(T-1): 前日の韓国総合株価指数200 (先物) 指数終値

(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>

(中略)

レバレッジ指数の計算方法

(中略)

指数リターンの数式を指数価値の数式に代入し、指数価値の数式の右辺を拡大させると以下ようになる：

$$\begin{aligned} \text{レバレッジ指数の価値}(t) &= (\text{レバレッジ指数の価値}(t-1)) \\ &\times [1 + [K \times [\text{対象指数}(t)/\text{対象指数}(t-1) - 1] - (K-1) \times (\text{借入金利}/360) \times D(t, t-1)]] \end{aligned}$$

K = レバレッジ・レシオ

K = 2, エクスポージャー = 200%

借入金利 = 3ヶ月円Libor(JY0003M)

Dt, t-1 = t とt-1 の日付の間の暦日数

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)(DJIA2LJP)は、ダウ・ジョーンズ工業株価平均 (プライス・リターン、円ヘッジ) (DJIHJP)の2倍のレバレッジがかかっており、DJIA2LJPの数式は以下ようになる。

$$\begin{aligned} \text{DJIA2LJP}(t) &= \\ &\text{DJIA2LJP}(t-1) \times [1 + [2 \times [\text{DJIHJP}(t)/\text{DJIHJP}(t-1) - 1] - (2-1) \times [\text{JY0003M}/360] \times D(t, t-1)]] \end{aligned}$$

インバース指数の計算方法

(中略)

指数リターンの数式を指数価値の数式に代入し、指数価値の数式の右辺を拡大させると以下ようになる：

$$\text{インバース指数の価値}(t) = (\text{インバース指数の価値}(t-1))$$

$$\times [1 - [K \times [\text{対象指数のトータルリターン}(t) / \text{対象指数のトータルリターン}(t-1) - 1] - (K+1) \times (\text{貸出金利}/360) \times D(t, t-1)]]$$

K = レバレッジ・レシオ

K = 1, エクスポージャー = 100%

貸出金利 = 3ヶ月円Libor(JY0003M)

Dt, t-1 = t と t-1 の日付の間の暦日数

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)(DJIAIJT)は、ダウ・ジョーンズ工業株価平均(トータル・リターン、円ヘッジ)(DJIHJT)のインバース・バージョンである。DJIAIJTの数式は以下のようになる。

DJIAIJT(t)=

$$DJIAIJT(t-1) \times [1 - [1 \times [DJIHJT(t) / DJIHJT(t-1) - 1] - (1+1) \times [JY0003M/360] \times D(t, t-1)]]$$

(中略)

東証マザーズ指数に関する留意点

東京証券取引所が進める市場区分の見直しに伴い、マザーズ市場の廃止が予定されている。東京証券取引所は、東証マザーズ指数を2022年4月の市場区分の見直し以降も継続して算出、配信することとし、TOPIX(東証株価指数)の取扱いに準じて、新市場区分に基づく銘柄選定へ段階的に移行する旨を発表している。詳細は、東京証券取引所のウェブサイト(<https://www.jpx.co.jp/> (またはその承継URL))で公表される最新の情報を確認されたい。

したがって、これらの変更が、東証マザーズ指数の数値、ひいては満期時または償還時に本外国指標連動証券および/または本受益権に対して支払われる金額ならびに満期前の本外国指標連動証券および/または本受益権の時価に影響するおそれがある。

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)およびダウ・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)の算出または公表が中止または一時停止される可能性がある

Libor運営機関であるICE Benchmark Administrationは、米ドルの一部テナーを除き、現行のパネル行が呈示するレートを一定の算出方法に基づき算出するLibor(ロンドン銀行間取引金利)については、2021年12月末をもって公表停止する旨発表している。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)およびダウ・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)は、その計算においてレバレッジ/インバースに伴う借入/貸出金利として3ヶ月円Liborを参照しているため、インデックス・スポンサーであるS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、2021年末までに代替金利指標へ移行することを発表している。ただし、未だ移行日は未定であり、仮に代替金利指標への移行計画が円滑に実行できなかった場合、本指数の算出または公表が中止または一時停止される可能性がある。その結果、本外国指標連動証券が期限前償還される等、本外国指標連動証券および/または本受益権に重大な悪影響を及ぼす可能性がある。

(中略)

<NEXT NOTES S&P500 配当貴族(ネットリターン) ETN、NEXT NOTES S&P シンガポール リート(ネットリターン) ETN、NEXT NOTES インドNifty・ダブル・ブル ETNおよびNEXT NOTES インドNifty・ベア ETNに関する情報>

(中略)

Nifty50 レバレッジ(2倍)インデックス(プライスリターン)の計算方法

$$\text{NPR2XL}(T) = \text{NPR2XL}(T-1) \times (1 + \text{NPR2XL_RETURN})$$

$$\text{NPR2XL_RETURN} = 2 \times (\text{NIFTY_PR}(T) / \text{NIFTY_PR}(T-1) - 1) - (\text{CBL0}(T-1) / 360) \times D(T, T-1)$$

NPR2XL(T) : 指数計算日(T)におけるNifty50 レバレッジ(2倍)インデックス(プライスリターン)値

NPR2XL(T-1) : 指数計算日(T)の前日におけるNifty50 レバレッジ(2倍)インデックス(プライスリターン)値

NIFTY_PR(T) : 指数計算日(T)におけるNIFTY 50指数(プライスリターン)値

NIFTY_PR(T-1) : 指数計算日(T)の前日におけるNIFTY 50指数(プライスリターン)値

D(T, T-1) : TからT-1までの実日数

CBL0(T-1) : 指数計算日(T)の前日のCBL0レート (% 年率)

CBL0レート : 貸借取引に適用されるオーバーナイト金利 (% 年率)

Nifty50 デイリーインバースインデックス(トータルリターン)の計算方法

$$\text{NTR1XI}(T) = \text{NTR1XI}(T-1) \times (1 + \text{NTR1XI_RETURN})$$

$$\text{NTR1XI_RETURN} = -1 \times (\text{NIFTY_TR}(T) / \text{NIFTY_TR}(T-1) - 1) + 2 \times (\text{CBL0}(T-1) / 360) \times D(T, T-1) - (\text{CBL0}(T-1) / 360) \times D(T, T-1)$$

NTR1XI(T) : 指数計算日(T)におけるNifty50 デイリーインバースインデックス(トータルリターン)値

NTR1XI(T-1) : 指数計算日(T)の前日におけるNifty50 デイリーインバースインデックス(トータルリターン)値

NIFTY_TR(T) : 指数計算日(T)におけるNIFTY 50トータルリターン指数値

NIFTY_TR(T-1) : 指数計算日(T)の前日における NIFTY 50トータルリターン指数値

D(T, T-1) : TからT-1までの実日数

CBL0(T-1) : 指数計算日(T)の前日のCBL0レート (% 年率)

CBL0レート : 貸借取引に適用されるオーバーナイト金利 (% 年率)

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

<NEXT NOTES 香港ハンセン・ダブル・ブル ETN、NEXT NOTES 香港ハンセン・ベア ETN、NEXT NOTES 韓国KOSPI・ダブル・ブル ETNおよびNEXT NOTES 韓国KOSPI・ベア ETNに関する情報>

(中略)

韓国総合株価指数200・レバレッジインデックスの計算方法

$$L(T) = L(T-1) \times [1 + \{K \times (\underline{S}(T) / \underline{S}(T-1) - 1) - (K-1) \times (r/365) \times D(T, T-1) \}]$$

L(T) : 指数計算時点(T)における韓国総合株価指数200・レバレッジインデックス値

$I(T-1)$: 指数計算時点(T)の前日における韓国総合株価指数200・レバレッジインデックス値

K: 2

$D(T, T-1)$: TからT-1までの実日数

r: 91日満期CDの金利(% 年率)

$\underline{I}(T)$: 現在の韓国総合株価指数200指数値

$\underline{I}(T-1)$: 前日の韓国総合株価指数200指数終値

韓国総合株価指数200 (先物) ・インバースインデックスの計算方法

$$I(T) = I(T-1) \times [1 + \{K \times (F(T)/F(T-1) - 1) + (1 - \underline{K}) \times \underline{M}\} \times (r/365) \times D(T, T-1)]$$

$I(T)$: 指数計算時点(T)における韓国総合株価指数200 (先物) ・インバースインデックス値

$I(T-1)$: 指数計算時点(T)の前日における韓国総合株価指数200 (先物) ・インバースインデックス値

K: $\underline{-1}$

$\underline{M}$: 先物マージン・レート

$D(T, T-1)$: TからT-1までの実日数

r: 91日満期CDの金利(% 年率)

$F(T)$: 現在の韓国総合株価指数200 (先物) 指数値

$F(T-1)$: 前日の韓国総合株価指数200 (先物) 指数終値

(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>

(中略)

レバレッジ指数の計算方法

(中略)

指数リターンの数式を指数価値の数式に代入し、指数価値の数式の右辺を拡大させると以下ようになる：

$$\begin{aligned} \text{レバレッジ指数の価値}(t) &= (\text{レバレッジ指数の価値}(t-1)) \\ &\times [1 + \{K \times [\text{対象指数}(t)/\text{対象指数}(t-1) - 1] - (K-1) \times (\text{借入金利}/360) \times D(t, t-1)\}] \end{aligned}$$

K = レバレッジ・レシオ

K = 2, エクスపోージャー = 200%

借入金利 = 3ヶ月日本円TIBOR(TI0003M)

$D_t, t-1$ = t とt-1 の日付の間の暦日数

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)(DJIA2LJP)は、ダウ・ジョーンズ工業株価平均(プライス・リターン、円ヘッジ)(DJIHJP)の2倍のレバレッジがかかっており、DJIA2LJPの数式は以下ようになる。

$$\begin{aligned} DJIA2LJP(t) &= \\ DJIA2LJP(t-1) &\times [1 + \{2 \times [DJIHJP(t)/DJIHJP(t-1) - 1] - (2-1) \times [TI0003M/360] \times D(t, t-1)\}] \end{aligned}$$

インバース指数の計算方法

(中略)

指数リターンの数式を指数価値の数式に代入し、指数価値の数式の右辺を拡大させると以下ようになる：

$$\begin{aligned} \text{インバース指数の価値}(t) = & (\text{インバース指数の価値}(t-1)) \\ & \times [1 - [K \times [\text{対象指数のトータルリターン}(t) / \text{対象指数のトータルリターン}(t-1) - 1] \\ & - (K+1) \times (\text{貸出金利}/360) \times D(t, t-1)]] \end{aligned}$$

K = レバレッジ・レシオ

K = 1, エクスポーチャー = 100%

貸出金利 = 3ヶ月日本円TIBOR(TI0003M)

Dt, t-1 = t とt-1 の日付の間の暦日数

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)(DJIAIJT)は、ダウ・ジョーンズ工業株価平均(トータル・リターン、円ヘッジ)(DJIHJT)のインバース・バージョンである。DJIAIJTの数式は以下ようになる。

$$\begin{aligned} \text{DJIAIJT}(t) = & \\ & \text{DJIAIJT}(t-1) \times [1 - [1 \times [\text{DJIHJT}(t) / \text{DJIHJT}(t-1) - 1] - (1+1) \times [\text{TI0003M}/360] \times D(t, t-1)]]] \end{aligned}$$

(中略)

東証マザーズ指数に関する留意点

東京証券取引所が進める市場区分の見直しに伴い、マザーズ市場の廃止が予定されている。東京証券取引所は、東証マザーズ指数を2022年4月の市場区分の見直し以降も継続して算出、配信することとし、TOPIX(東証株価指数)の取扱いに準じて、新市場区分に基づく銘柄選定へ段階的に移行する旨を発表している。詳細は、東京証券取引所のウェブサイト(<https://www.jpx.co.jp/> (またはその承継URL))で公表される最新の情報を確認されたい。

したがって、これらの変更が、東証マザーズ指数の数値、ひいては満期時または償還時に本外国指標連動証券および/または本受益権に対して支払われる金額ならびに満期前の本外国指標連動証券および/または本受益権の時価に影響するおそれがある。

(中略)

<NEXT NOTES S&P500 配当貴族(ネットリターン) ETN、NEXT NOTES S&P シンガポール リート(ネットリターン) ETN、NEXT NOTES インドNifty・ダブル・ブル ETNおよびNEXT NOTES インドNifty・ベア ETNに関する情報>

(中略)

Nifty50 レバレッジ(2倍)インデックス(プライスリターン)の計算方法

$$\text{NPR2XL}(T) = \text{NPR2XL}(T-1) \times (1 + \text{NPR2XL_RETURN})$$

$$\text{NPR2XL_RETURN} = 2 \times (\text{NIFTY_PR}(T) / \text{NIFTY_PR}(T-1) - 1) - (\text{TREPS}(T-1) / 360) \times D(T, T-1)$$

NPR2XL(T)：指数計算日(T)におけるNifty50 レバレッジ(2倍)インデックス(プライスリターン)値

NPR2XL(T-1)：指数計算日(T)の前日におけるNifty50 レバレッジ(2倍)インデックス(プライスリターン)値

NIFTY_PR(T)：指数計算日(T)におけるNIFTY 50指数(プライスリターン)値

NIFTY_PR(T-1)：指数計算日(T)の前日におけるNIFTY 50指数(プライスリターン)値

D(T, T-1)：TからT-1までの実日数

TREPS(T-1)：指数計算日(T)の前日のTREPSレート（％ 年率）

TREPSレート：貸借取引に適用されるオーバーナイト金利（％ 年率）

Nifty50 デイリーインバースインデックス(トータルリターン)の計算方法

$$\text{NTR1XI}(T) = \text{NTR1XI}(T-1) \times (1 + \text{NTR1XI_RETURN})$$

$$\text{NTR1XI_RETURN} = -1 \times (\text{NIFTY_TR}(T) / \text{NIFTY_TR}(T-1) - 1) + 2 \times (\text{TREPS}(T-1) / 360) \times D(T, T-1) - (\text{TREPS}(T-1) / 360) \times D(T, T-1)$$

NTR1XI(T)：指数計算日(T)におけるNifty50 デイリーインバースインデックス(トータルリターン)値

NTR1XI(T-1)：指数計算日(T)の前日におけるNifty50 デイリーインバースインデックス(トータルリターン)値

NIFTY_TR(T)：指数計算日(T)におけるNIFTY 50トータルリターン指数値

NIFTY_TR(T-1)：指数計算日(T)の前日における NIFTY 50トータルリターン指数値

D(T, T-1)：TからT-1までの実日数

TREPS(T-1)：指数計算日(T)の前日のTREPSレート（％ 年率）

TREPSレート：貸借取引に適用されるオーバーナイト金利（％ 年率）

（後略）

【募集又は売出しに関する特別記載事項】

<訂正前>

（前略）

<NEXT NOTES 香港ハンセン・ダブル・ブル ETNに関する情報>

（中略）

連動対象となる 指標の概要	連動対象となる指標は、日々の騰落率がハンセン指数の日々の騰落率の2倍として計算されたハンセン指数・レバレッジインデックス（香港ドル建て）を円換算したものです。その円換算前の値動きはNEXT NOTES ウェブサイト（https://nextnotes.com/（またはその承継URL））をご参照下さい。 なお、ハンセン指数は、香港取引所のメインボードに上場している銘柄のうち、時価総額が大きく、流動性の高い銘柄で構成される指数です。ハンセン・インデックス・カンパニー・リミテッドは、構成銘柄数を2022年半ばまでに80銘柄に増やし、最終的に100銘柄に固定することを目標としています。
------------------	---

（中略）

<NEXT NOTES 香港ハンセン・ベア ETNに関する情報>

（中略）

連動対象となる 指標の概要	連動対象となる指標は、日々の騰落率がハンセン指数（配当込指数）の日々の騰落率の - 1 倍として計算されたハンセン指数・ショートインデックス指数（香港ドル建て）を円換算したものです。その円換算前の値動きはNEXT NOTES ウェブサイト（https://nextnotes.com/（またはその承継URL））をご参照下さい。 なお、ハンセン指数は、香港取引所のメインボードに上場している銘柄のうち、時価総額が大きく、流動性の高い銘柄で構成される指数です。ハンセン・インデックス・カンパニー・リミテッドは、構成銘柄数を2022年半ばまでに80銘柄に増やし、最終的に100銘柄に固定することを目標としています。
------------------	---

（中略）

<NEXT NOTES 韓国KOSPI・ダブル・ブル ETNに関する情報>

（中略）

連動対象となる 指標の概要	連動対象となる指標は、日々の騰落率が韓国総合株価指数200の日々の騰落率の 2 倍として計算された韓国総合株価指数200・レバレッジインデックス（韓国ウォン建て）を円換算したものです。その円換算前の値動きはNEXT NOTES ウェブサイト（https://nextnotes.com/（またはその承継URL））をご参照下さい。 なお、韓国総合株価指数200は、韓国証券取引所上場の主要200銘柄で構成される指数です。
------------------	--

（中略）

<NEXT NOTES 韓国KOSPI・ベア ETNに関する情報>

（中略）

連動対象となる 指標の概要	連動対象となる指標は、日々の騰落率が韓国総合株価指数200（先物）の日々の騰落率の - 1 倍として計算された韓国総合株価指数200（先物）・インバースインデックス（韓国ウォン建て）を円換算したものです。その円換算前の値動きはNEXT NOTES ウェブサイト（https://nextnotes.com/（またはその承継URL））をご参照下さい。 なお、韓国総合株価指数200（先物）は、韓国総合株価指数200先物市場に上場している直近限月の価格の値動きに連動した指数（ロールオーバーコスト込み）です。
------------------	---

（中略）

<NEXT NOTES NYダウ・ダブル・フル・ドルヘッジ ETNに関する情報>

(中略)

連動対象となる 指標の概要	連動対象となる指標は、日々の騰落率が、米ドル／円ヘッジされたダウ・ジョーンズ工業株価平均（プライス・リターン）の <u>日々の騰落率の2倍</u> として計算されたものです。その値動きはNEXT NOTESウェブサイト（ https://nextnotes.com/ （またはその承継URL））をご参照下さい。 なお、ダウ・ジョーンズ工業株価平均は、米国の代表的な企業（輸送業と公共事業を除く）の株式30銘柄で構成される指数です。
------------------	---

(中略)

<NEXT NOTES NYダウ・ベア・ドルヘッジ ETNに関する情報>

(中略)

連動対象となる 指標の概要	連動対象となる指標は、日々の騰落率が、米ドル／円ヘッジされたダウ・ジョーンズ工業株価平均（トータル・リターン）の <u>日々の騰落率の-1倍</u> として計算されたものです。その値動きはNEXT NOTESウェブサイト（ https://nextnotes.com/ （またはその承継URL））をご参照下さい。 なお、ダウ・ジョーンズ工業株価平均は、米国の代表的な企業（輸送業と公共事業を除く）の株式30銘柄で構成される指数です。
------------------	--

(中略)

<NEXT NOTES インドNifty・ダブル・フル ETNに関する情報>

(中略)

連動対象となる 指標の概要	連動対象となる指標は、日々の騰落率がNIFTY 50指数(プライスリターン)の <u>日々の騰落率の2倍</u> として計算された、Nifty50 レバレッジ(2倍)インデックス(プライスリターン)（インドルピー建て）を円換算したものです。その円換算前の値動きはNEXT NOTESウェブサイト（ https://nextnotes.com/ （またはその承継URL））をご参照下さい。 なお、NIFTY 50指数(プライスリターン)は、インド・ナショナル証券取引所に上場する主要な株式50銘柄で構成される指数です。
------------------	--

(中略)

<NEXT NOTES インドNifty・ベア ETNに関する情報>

(中略)

連動対象となる 指標の概要	連動対象となる指標は、日々の騰落率がNIFTY 50トータルリターン指数の日々の騰落率の - 1 倍として計算された、Nifty50 デイリーインバースインデックス(トータルリターン)(インドルピー建て)を円換算したものです。その円換算前の値動きはNEXT NOTESウェブサイト (https://nextnotes.com/ (またはその承継URL)) をご参照下さい。 なお、NIFTY 50トータルリターン指数は、インド・ナショナル証券取引所に上場する主要な株式50銘柄で構成される指数です。
------------------	---

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

< NEXT NOTES 香港ハンセン・ダブル・ブル ETNに関する情報 >

(中略)

連動対象となる 指標の概要	連動対象となる指標は、日々の騰落率がハンセン指数の日々の騰落率の 2 倍から金利・印紙税相当分を控除して計算されたハンセン指数・レバレッジインデックス(香港ドル建て)を円換算したものです。その円換算前の値動きはNEXT NOTESウェブサイト (https://nextnotes.com/ (またはその承継URL)) をご参照下さい。 なお、ハンセン指数は、香港取引所のメインボードに上場している銘柄のうち、時価総額が大きく、流動性の高い銘柄で構成される指数です。ハンセン・インデックス・カンパニー・リミテッドは、構成銘柄数を2022年半ばまでに80銘柄に増やし、最終的に100銘柄に固定することを目標としています。
------------------	--

(中略)

< NEXT NOTES 香港ハンセン・ベア ETNに関する情報 >

(中略)

連動対象となる 指標の概要	連動対象となる指標は、日々の騰落率がハンセン指数(配当込指数)の日々の騰落率の - 1 倍に金利相当分を加算し印紙税相当分を控除して計算されたハンセン指数・ショートインデックス(香港ドル建て)を円換算したものです。その円換算前の値動きはNEXT NOTESウェブサイト (https://nextnotes.com/ (またはその承継URL)) をご参照下さい。 なお、ハンセン指数は、香港取引所のメインボードに上場している銘柄のうち、時価総額が大きく、流動性の高い銘柄で構成される指数です。ハンセン・インデックス・カンパニー・リミテッドは、構成銘柄数を2022年半ばまでに80銘柄に増やし、最終的に100銘柄に固定することを目標としています。
------------------	---

(中略)

<NEXT NOTES 韓国KOSPI・ダブル・ブル ETNに関する情報>

(中略)

連動対象となる 指標の概要	連動対象となる指標は、日々の騰落率が韓国総合株価指数200の日々の騰落率の2倍から金利相当分を控除して計算された韓国総合株価指数200・レバレッジインデックス（韓国ウォン建て）を円換算したものです。その円換算前の値動きはNEXT NOTESウェブサイト（https://nextnotes.com/（またはその承継URL））をご参照下さい。 なお、韓国総合株価指数200は、韓国証券取引所上場の主要200銘柄で構成される指数です。
------------------	--

(中略)

<NEXT NOTES 韓国KOSPI・ベア ETNに関する情報>

(中略)

連動対象となる 指標の概要	連動対象となる指標は、日々の騰落率が韓国総合株価指数200（先物）の日々の騰落率の - 1 倍に金利相当分を加算して計算された韓国総合株価指数200（先物）・インバースインデックス（韓国ウォン建て）を円換算したものです。その円換算前の値動きはNEXT NOTESウェブサイト（https://nextnotes.com/（またはその承継URL））をご参照下さい。 なお、韓国総合株価指数200（先物）は、韓国総合株価指数200先物市場に上場している直近限月の価格の値動きに連動した指数（ロールオーバーコスト込み）です。
------------------	--

(中略)

<NEXT NOTES NYダウ・ダブル・ブル・ドルヘッジ ETNに関する情報>

(中略)

連動対象となる 指標の概要	連動対象となる指標は、日々の騰落率が、米ドル／円ヘッジされたダウ・ジョーンズ工業株価平均（プライス・リターン）の日々の騰落率の2倍から金利相当分を控除して計算されたものです。その値動きはNEXT NOTESウェブサイト（https://nextnotes.com/（またはその承継URL））をご参照下さい。 なお、ダウ・ジョーンズ工業株価平均は、米国の代表的な企業（輸送業と公共事業を除く）の株式30銘柄で構成される指数です。
------------------	--

(中略)

<NEXT NOTES NYダウ・ベア・ドルヘッジ ETNに関する情報>

(中略)

連動対象となる 指標の概要	連動対象となる指標は、日々の騰落率が、米ドル/円ヘッジされたダウ・ジョーンズ工業株価平均 (トータル・リターン) の日々の騰落率の - 1 倍に金利相当分を加算して計算されたものです。その値動きはNEXT NOTESウェブサイト (https://nextnotes.com/ (またはその承継URL)) をご参照下さい。 なお、ダウ・ジョーンズ工業株価平均は、米国の代表的な企業 (輸送業と公共事業を除く) の株式30銘柄で構成される指数です。
------------------	--

(中略)

<NEXT NOTES インドNifty・ダブル・ブル ETNに関する情報>

(中略)

連動対象となる 指標の概要	連動対象となる指標は、日々の騰落率がNIFTY 50指数(プライスリターン)の日々の騰落率の 2 倍から金利相当分を控除して計算された、Nifty50 レバレッジ(2倍)インデックス(プライスリターン) (インドルピー建て) を円換算したものです。その円換算前の値動きはNEXT NOTESウェブサイト (https://nextnotes.com/ (またはその承継URL)) をご参照下さい。 なお、NIFTY 50指数(プライスリターン)は、インド・ナショナル証券取引所に上場する主要な株式50銘柄で構成される指数です。
------------------	--

(中略)

<NEXT NOTES インドNifty・ベア ETNに関する情報>

(中略)

連動対象となる 指標の概要	連動対象となる指標は、日々の騰落率がNIFTY 50トータルリターン指数の日々の騰落率の - 1 倍に金利相当分を加算して計算された、Nifty50 デイリーインバースインデックス(トータルリターン) (インドルピー建て) を円換算したものです。その円換算前の値動きはNEXT NOTESウェブサイト (https://nextnotes.com/ (またはその承継URL)) をご参照下さい。 なお、NIFTY 50トータルリターン指数は、インド・ナショナル証券取引所に上場する主要な株式50銘柄で構成される指数です。
------------------	---

(後略)

第三部【追完情報】

<訂正前>

1 事業等のリスク

発行会社が2021年8月16日に関東財務局長に提出した有価証券報告書に記載の「事業等のリスク」については、当該有価証券報告書の提出日以後、本訂正届出書提出日 (2021年11月16日) までの間において生じた変更およびその他の事由はない。

また、当該有価証券報告書中には将来に関する事項が記載されているが、当該事項は本訂正届出書提出日(2021年11月16日)現在においてもその判断に変更はなく、新たに記載する将来に関する事項もない。

<訂正後>

1 事業等のリスク

発行会社が2021年8月16日に関東財務局長に提出した有価証券報告書および2021年12月22日に関東財務局長に提出した半期報告書(以下「有価証券報告書等」という。)に記載の「事業等のリスク」については、当該有価証券報告書等の提出日以後、本訂正届出書提出日(2021年12月23日)までの間において生じた変更およびその他の事由はない。

また、当該有価証券報告書等中には将来に関する事項が記載されているが、当該事項は本訂正届出書提出日(2021年12月23日)現在においてもその判断に変更はなく、新たに記載する将来に関する事項もない。

第四部【組込情報】

<訂正前>

次に掲げる書類の写しを添付する。

(1) 有価証券報告書

事業年度(2021年3月期) 自 2020年4月1日 至 2021年3月31日

2021年8月16日 関東財務局長に提出

(2) 半期報告書

該当事項なし。

なお、上記書類は、金融商品取引法第27条の30の2に規定する開示用電子情報処理組織(EDINET)を使用して提出したデータを開示用電子情報処理組織による手続の特例等に関する留意事項について(電子開示手続等ガイドライン)A4-1に基づき本書の添付書類としている。

<訂正後>

次に掲げる書類の写しを添付する。

(1) 有価証券報告書

事業年度(2021年3月期) 自 2020年4月1日 至 2021年3月31日

2021年8月16日 関東財務局長に提出

(2) 半期報告書

2021年9月中間期 自 2021年4月1日 至 2021年9月30日

2021年12月22日 関東財務局長に提出

なお、上記書類は、金融商品取引法第27条の30の2に規定する開示用電子情報処理組織(EDINET)を使用して提出したデータを開示用電子情報処理組織による手続の特例等に関する留意事項について(電子開示手続等ガイドライン)A4-1に基づき本書の添付書類としている。