

## 【表紙】

|            |   |
|------------|---|
| 【提出書類】     | 臨時報告書の訂正報告書   |
| 【提出先】      | 関東財務局長  |
| 【提出日】      | 平成25年7月5日   |
| 【会社名】      | アステラス製薬株式会社   |
| 【英訳名】      | Astellas Pharma Inc.  |
| 【代表者の役職氏名】 | 代表取締役社長 畑中 好彦   |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都中央区日本橋本町二丁目5番1号  |
| 【電話番号】     | 03(3244)3271  |
| 【事務連絡者氏名】  | 経理部長 村上 祐一  |
| 【最寄りの連絡場所】 | 東京都中央区日本橋本町二丁目5番1号  |
| 【電話番号】     | 03(3244)3271  |
| 【事務連絡者氏名】  | 経理部長 村上 祐一  |
| 【縦覧に供する場所】 | アステラス製薬株式会社埼玉支店<br>(さいたま市大宮区桜木町一丁目7番地5)<br>アステラス製薬株式会社千葉支店<br>(千葉市美浜区中瀬二丁目6番地1)<br>アステラス製薬株式会社横浜支店<br>(横浜市西区みなとみらい二丁目2番1号)<br>アステラス製薬株式会社名古屋支店<br>(名古屋市中区丸の内二丁目1番36号)<br>アステラス製薬株式会社大阪支店<br>(大阪府中央区瓦町三丁目6番5号)<br>アステラス製薬株式会社神戸支店<br>(神戸市中央区磯辺通三丁目1番7号)<br>株式会社東京証券取引所<br>(東京都中央区日本橋兜町2番1号)<br>株式会社大阪証券取引所<br>(大阪府中央区北浜一丁目8番16号) |

## 1【臨時報告書の訂正報告書の提出理由】

平成25年6月19日付をもって提出した臨時報告書の記載事項のうち、新株予約権の発行価格等、未定の事項が平成25年7月4日に確定しましたので、金融商品取引法第24条の5第5項の規定に基づき、臨時報告書の訂正報告書を提出するものです。

## 2【訂正内容】

### (3) 発行価格

(訂正前)

二項モデルにより以下の基礎数値に基づき算出した1株当たりのオプション価格に下記(5)に定める付与株式数を乗じた金額とする。

但し、二項モデルによる算定方法は以下の通りである。

割当日から権利行使終了日までの期間 $T$ を間隔 $\Delta t$ で等分割したとき、時点 $(i, j)$ におけるオプション価値 $C_{i,j}$ は、株価変動性 $\sigma$ 、無リスクの利率 $r$ 、配当利回り $q$ を用いて

$$C_{i,j} = e^{-r\Delta t} (pC_{i+1,j+1} + (1-p)C_{i+1,j}) \cdots (1)$$

$$p = \frac{e^{(r-q)\Delta t} - d}{u - d}$$

$$u = e^{\sigma\sqrt{\Delta t}}$$

$$d = e^{-\sigma\sqrt{\Delta t}}$$

と表すことができる。

また、権利行使終了日時点におけるオプション価値は、株価 $S$ 、行使価格 $X$ を用いて、

$$C_{N,j} = \max(S \cdot u^j \cdot d^{N-j} - X, 0) \quad j = 0, 1, 2, \dots, N$$

$$N = \frac{T}{\Delta t}$$

となる。ここで、 $\Delta t$ である。この権利行使終了日時点のオプション価値 $C_{N,j}$ を(1)式を用いて、 $i = N$

から $i = 0$ まで逐次的に解くと、割当日時点 $(0, 0)$ におけるオプション価値 $C_{0,0}$ が得られ、これが1株当たりのオプション価値となる。

さらに、期中の行使が可能である期間には、(1)式の代わりに次式を用いることで、早期行使を考慮して1株当たりのオプション価値を求めることができる。

$$C_{i,j} = \max(S \cdot u^j \cdot d^{i-j} - X, e^{-r\Delta t} (pC_{i+1,j+1} + (1-p)C_{i+1,j})) \cdots (2)$$

本件においては、割当日から権利確定日までの期間 $\tau$ については、(1)式、権利行使開始日から権利行使終了日までの期間 $(T - \tau)$ については、(2)式を用いて1株当たりのオプション価値 $C_{0,0}$ を算定した。

1株当たりのオプション価格 $(C_{0,0})$

株価 $(S)$ ：平成25年7月4日の東京証券取引所における当社普通株式の普通取引の終値（当日に終値がない場合は、それに先立つ直近の取引日の終値）

行使価格 $(X)$ ：1円

割当日から権利確定日までの期間 $(\tau)$ ：3年

割当日から満期までの期間 $(T)$ ：20年

株価変動性 $(\sigma)$ ：20年間（平成5年7月4日から平成25年7月4日まで）の当社普通株式の普通取引の各取引日の終値に基づき算出した変動率

無リスクの利率 $(r)$ ：残存年数が上記に定める期間に対応する国債の利率

配当利回り $(q)$ ：1株当たりの配当金（平成24年9月中間期および平成25年3月期末の配当実績）÷上記に定める株価

(訂正後)

新株予約権 1 個当たり505,300円 ( 1 株当たり5,053円 ) とする。

(4) 発行価額の総額

(訂正前) 未定

(訂正後) 357,247,100円

訂正箇所は\_\_\_\_\_ 罫で示しています。