

【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】 令和元年7月10日

【会社名】 ルネサスエレクトロニクス株式会社

【英訳名】 Renesas Electronics Corporation

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長兼CEO 柴田 英利

【本店の所在の場所】 東京都江東区豊洲三丁目2番24号

【電話番号】 03(6773)3000(代表)

【事務連絡者氏名】 企業法務部長 橋口 幸武

【最寄りの連絡場所】 東京都江東区豊洲三丁目2番24号

【電話番号】 03(6773)3000(代表)

【事務連絡者氏名】 企業法務部長 橋口 幸武

【届出の対象とした募集有価証券の種類】 新株予約権証券

【届出の対象とした募集金額】

その他の者に対する割当	
2019年度新株予約権第6号	1,271,920,000円
2019年度新株予約権第7号	0円
発行価額の総額に新株予約権の行使に際して払い込むべき金額の合計額を合算した金額	
2019年度新株予約権第6号	1,274,366,000円
2019年度新株予約権第7号	17,278,700円

(注)

1. 本募集は、令和元年6月25日付の当社取締役会決議に基づき、ストックオプションを目的として、新株予約権を発行するものであります。
2. 募集金額は、新株予約権がストックオプションとしての目的で発行されることから、2019年度新株予約権第6号については、1,271,920,000円とし、2019年度新株予約権第7号については、金銭による払込みを要しないため、0円とします。また、2019年度新株予約権第6号に係る募集金額並びに2019年度新株予約権第6号及び2019年度新株予約権第7号に係る発行価額の総額に新株予約権の行使に際して払い込むべき金額の合計額を合算した金額は、令和元年6月25日提出の有価証券届出書提出時の見込額(令和元年6月24日時点の東京証券取引所における当社普通株式の終値を基準とします。)です。
3. 新株予約権の行使期間内に新株予約権の行使が行われない場合、新株予約権の割当てを受けた者がその権利を喪失した場合、及び当社が取得した新株予約権を消却した場合には、発行価額の総額に新株予約権の行使に際して払い込むべき金額の合計額を合算した金額は減少します。

【安定操作に関する事項】

該当事項はありません。

【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】

令和元年6月25日に関東財務局長に提出した有価証券届出書の記載事項のうち、2019年度新株予約権第6号の発行価格に誤記がありましたので、これを訂正するため、有価証券届出書の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 新規発行新株予約権証券(2019年度新株予約権第6号)

(1) 募集の条件

3 【訂正箇所】

訂正箇所は_____ 罫で示しております。

第一部 【証券情報】

第1 【募集要項】

1 【新規発行新株予約権証券(2019年度新株予約権第6号)】

(1) 【募集の条件】

(訂正前)

(略)	(略)
発行価格	<p>発行価格は、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付与株式数を乗じた金額とします。</p> <p>但し、二項モデルによる算定方法は以下の通りです。</p> <p>割当日から権利行使終了日までの期間Tを間隔Δt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σ、無リスクの利子率r、配当利回りqを用いて、</p> $C_{i,j} = e^{-r\Delta t}(pC_{i+1,j+1} + (1-p)C_{i+1,j}) \quad \dots (1)$ $p = \frac{e^{(r-q)\Delta t} - d}{u - d}$ $u = e^{\sigma\sqrt{\Delta t}}$ $d = e^{-\sigma\sqrt{\Delta t}}$ <p>と表すことができる。</p> <p>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、</p> $C_{N,j} = \max(S \cdot u^j \cdot d^{N-j} - X, 0) \quad j=0,1,2,\dots,N$ <p>となる。ここで、$N = \frac{T}{\Delta t}$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$i = 0$までを逐次的に解くと、割当日時$(0,0)$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。</p> <p>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。</p> $C_{i,j} = \max(S \cdot u^j \cdot d^{i-j} - X, e^{-r\Delta t}(pC_{i+1,j+1} + (1-p)C_{i+1,j})) \quad \dots (2)$ <p>本件においては、割当日から権利確定日までの期間τ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株あたりのオプション価値$C_{0,0}$を算出した。</p> <p>1株当たりのオプション価格($C_{0,0}$)</p> <p>オプションの発行日の株価(S)：令和元年7月25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(終値がない場合は、翌取引日の基準値段)</p> <p>オプションの行使価格(X)：1円</p> <p>割当日から権利確定日までの期間()：2.7年</p> <p>割当日から権利行使終了日までのオプション期間(T)：5年</p> <p>株価変動性()：オプションの発行日からオプション期間分遡った期間の各週の最終取引日における当社普通株式の普通取引の終値に基づき算出した変動率</p> <p>無リスクの利子率(r)：残存期間がオプション期間に対応する国債の割当日における利回り</p> <p>配当利回り(q)：1株当たりの配当金(平成31年12月期の配当実績)÷オプションの発行日の株価</p> <p>(注)令和元年7月25日に決定する予定です。</p>
(略)	(略)

(注略)

(訂正後)

(略)	(略)
発行価格	<p>発行価格は、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付与株式数を乗じた金額とします。</p> <p>但し、二項モデルによる算定方法は以下の通りです。</p> <p>割当日から権利行使終了日までの期間Tを間隔Δt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σ、無リスクの利子率r、配当利回りqを用いて、</p> $C_{i,j} = e^{-r\Delta t}(pC_{i+1,j+1} + (1-p)C_{i+1,j}) \dots (1)$ $p = \frac{e^{(r-q)\Delta t} - d}{u - d}$ $u = e^{\sigma\sqrt{\Delta t}}$ $d = e^{-\sigma\sqrt{\Delta t}}$ <p>と表すことができる。</p> <p>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、</p> $C_{N,j} = \max(S \cdot u^j \cdot d^{N-j} - X, 0) \quad j=0,1,2,\dots,N$ <p>となる。ここで、$N = \frac{T}{\Delta t}$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$i=0$までを逐次的に解くと、割当日時$(0,0)$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。</p> <p>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。</p> $C_{i,j} = \max(S \cdot u^j \cdot d^{i-j} - X, e^{-r\Delta t}(pC_{i+1,j+1} + (1-p)C_{i+1,j})) \dots (2)$ <p>本件においては、割当日から権利確定日までの期間τ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株あたりのオプション価値$C_{0,0}$を算出した。</p> <p>1株当たりのオプション価格($C_{0,0}$)</p> <p>オプションの発行日の株価(S)：令和元年7月25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(終値がない場合は、翌取引日の基準値段)</p> <p>オプションの行使価格(X)：1円</p> <p>割当日から権利確定日までの期間()：2.7年</p> <p>割当日から権利行使終了日までのオプション期間(T)：5年</p> <p>株価変動性()：オプションの発行日からオプション期間分遡った期間の各週の最終取引日における当社普通株式の普通取引の終値に基づき算出した変動率</p> <p>無リスクの利子率(r)：残存期間がオプション期間に対応する国債の割当日における利回り</p> <p>配当利回り(q)：1株当たりの配当金(平成30年12月期の配当実績)÷オプションの発行日の株価</p> <p>(注)令和元年7月25日に決定する予定です。</p>
(略)	(略)

(注略)