

【表紙】

【発行登録追補書類番号】 4 - 外 1 - 11

【提出書類】 発行登録追補書類

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 令和 5 年 9 月 20 日

【会社名】 モルガン・スタンレー
(Morgan Stanley)

【代表者の役職氏名】 授権署名者 金森 保道
(Yasumichi Kanamori, Authorized Signatory)

【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・友常法律事務所外国法共同事業

【電話番号】 (03)6775-1000

【事務連絡者氏名】 弁 護 士 塩 見 竜 一
同 瀧 川 亮 祐
同 打 田 峻
同 早 田 尚 史
同 中 島 滉 平
同 宮 本 健 太
同 安 達 結 希

【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)6775-1000

【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】 13,888,527米ドル (円貨額2,051,752,094円)
(円貨額は、2023年 9 月 19 日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値である 1 米ドル = 147.73円を換算レートとして計算されている。)

【発行登録書の内容】

提出日	令和 4 年 9 月 29 日
効力発生日	令和 4 年 10 月 7 日
有効期限	令和 6 年 10 月 6 日
発行登録番号	4 - 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
4-外1-1	令和4年12月16日	313,204,346円	該当事項なし	該当事項なし
4-外1-2	令和4年12月16日	166,584,600円		
4-外1-3	令和4年12月16日	249,801,160円		
4-外1-4	令和5年3月7日	281,998,920円		
4-外1-5	令和5年3月7日	284,083,800円		
4-外1-6	令和5年3月28日	479,171,000円		
4-外1-7	令和5年3月28日	220,395,670円		
4-外1-8	令和5年7月3日	920,924,159円		
4-外1-9	令和5年7月3日	1,753,777,935円		
実績合計額		4,669,941,590円	減額総額	0円

【残額】(発行予定額 - 実績合計額 - 減額総額) 775,330,058,410円

(注) モルガン・スタンレーは「モルガン・スタンレー 2038年9月28日満期 豪ドル建ゼロクーポン社債」(売出総額4,521,858豪ドル(円価額429,847,821円))の売出しを行うために、令和5年9月20日に発行登録追補書類(発行登録追補書類番号 4-外1-10)を関東財務局長に提出したが、令和5年9月28日が当該社債の受渡期日であり、本書の提出日現在当該社債の受渡し完了していないため、上記金額を上記の実績合計額欄に加算し、また、上記の[残額]から控除することはしていない。

(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 2038年9月28日満期 米ドル建ゼロクーポン社債に関する情報]

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	29,670,000米ドル
売出価額の総額	13,888,527米ドル

2【売出しの条件】

売 出 価 格	額面の46.81%
---------	-----------

4. 償還および買入れ

4.3 課税事由による償還

本社債は、

(i) 米国、または米国のもしくは米国内の行政上の下部組織もしくは課税当局の法律または法律に基づき制定された規則もしくは命令において、課税に影響を及ぼす変更または修正がなされ、または、

(ii) 上述の法律、規則または命令の適用または解釈に関し公式見解に変更が生じ、かかる変更または修正がプライシングサプリメントの日付以降に効力を生じた結果、発行会社が、本社債に関して後記社債要項第6.1項(追加額)に記載される追加額を支払う義務を負っているかまたは負うことになると判断した場合、発行会社の選択により、後記社債要項第13項(通知)に記載する償還通知の付与をもって、以下に記載する適用償還価格(および償還日までに生じた利息)により、満期前のいつでも一括で償還(一部償還は認められない。)することができる。発行会社は、課税事由による償還が生じた場合にはこれを通知する。

償還通知は償還予定日前60日から30日までの間に付与される。日付および適用償還価格は後記社債要項第13項(通知)に従い交付される通知において特定される。

適用償還価格は、計算代理人が決定する米ドルにおける金額とし、(a)当該本社債の計算金額に(b)以下の算式に従って算出される比率を乗じて得られる積とする。

$$\text{参照価格} \times (1 + \text{償却利回り})^n$$

本項において、

「計算金額」とは、10,000米ドルをいう。

「計算代理人」とは、モルガン・スタンレーMUFJ証券株式会社およびその承継人をいう。

「参照価格」とは、46.81%である。

「償却利回り」とは、年率5.19%を小数で表示したものである。

「n」とは、本社債の発行日(同日を含む。)から当該本社債の履行期が到来し支払われるべきものとなった日(期限前償還日を含む。)(同日を含まない。)までの年数であり、日数計算式(30/360)(ISDA)に基づき算出される。

「日数計算式(30/360)(ISDA)」とは、計算期間の日数を360で除して得られる数を意味し、その際の計算式は次のとおりとする。

$$\text{日数計算式(30/360)(ISDA)} = \frac{[360x(Y_2-Y_1)]+[30x(M_2-M_1)]+(D_2-D_1)}{360}$$

「Y₁」は、計算期間の初日が属する年を示す数値を意味する。

「Y₂」は、計算期間末日の翌日が属する年を示す数値を意味する。

「M₁」は、計算期間の初日が属する暦月を示す数値を意味する。

「M₂」は、計算期間末日の翌日が属する暦月を示す数値を意味する。

「D₁」は、計算期間に属する最初の暦日を示す数値を意味する。ただし、その数値が31である場合には、D₁は30とする。

「D₂」は、計算期間末日の翌暦日を示す数値を意味する。ただし、その数値が31であり、かつD₁が29より大きな数値である場合には、D₂は30とする。

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。

「本書および本社債に関する2023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、本書では令和5年8月25日付訂正発行登録書および令和5年9月20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 2022年度（自2022年1月1日 至2022年12月31日）
令和5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】
上記1の有価証券報告書提出後、本発行登録追補書類提出日（令和5年9月20日）までに、金融商品取引法第24条の5第4項および企業内容等の開示に関する内閣府令第19条第2項第1号の規定に基づき臨時報告書を令和5年7月26日に関東財務局長に提出
- 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（令和5年9月20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（令和5年9月20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】

該当事項なし。