

【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】 2018年8月14日

【会社名】 株式会社めぶきフィナンシャルグループ

【英訳名】 Mebuki Financial Group, Inc.

【代表者の役職氏名】 取締役社長 笹島 律夫

【本店の所在の場所】 東京都中央区八重洲二丁目7番2号

【電話番号】 (03)3241-2501(代表)

【事務連絡者氏名】 経営企画部統括部長 小野 利彦

【最寄りの連絡場所】 東京都中央区八重洲二丁目7番2号

【電話番号】 (03)3241-2501(代表)

【事務連絡者氏名】 東京事務所長 関 敏幸

【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 【提出理由】

2018年7月23日付けをもって提出した臨時報告書の記載事項のうち、「発行数」、「発行価格」及び「発行価額の総額」が2018年8月13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あります。

## 2 【訂正事項】

(注) 訂正箇所には下線を付しております。

・ 当社、株式会社常陽銀行および株式会社足利銀行の取締役に対して発行する新株予約権

### (2) 発行数

(訂正前)

139,780個

上記の総数は割当予定数であり、引受けの申込みの数が割当予定数に満たない場合等、割り当てる本新株予約権の総数が減少したときは、割り当てる新株予約権の総数をもって発行する新株予約権の総数とする。

(訂正後)

127,508個

### (3) 発行価格

(訂正前)

各新株予約権の払込金額(発行価額)は、以下の から の基礎数値に基づき、ブラック・ショールズ・モデルにより算出した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(1円未満の端数は切り上げ)とする。

$$C = Se^{-\lambda t} N(d_1) - e^{-rt} X N(d_2)$$

ここで、

$$d_1 = \frac{\ln\left(\frac{S}{X}\right) + \left(r - \lambda + \frac{\sigma^2}{2}\right)t}{\sigma\sqrt{t}}, d_2 = d_1 - \sigma\sqrt{t}$$

1株当たりのオプション価格 (C)

株価 (S) : 2018年8月13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)

行使価格 (X) : 1円

予想残存期間 (t) : 6年

ボラティリティ (σ) : 6年間(2012年8月14日から2018年8月13日まで)の各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

なお、本評価においては、株式会社常陽銀行との間で株式交換による経営統合を実施してからの期間が短いことなどから、経営統合以前の期間においては、当社と類似性の高い企業を選定のうえ、ボラティリティの算出に必要な情報量を補い算定する。

無リスクの利子率 (r) : 残存年数が予想残存期間に対応する国債の利子率

配当利回り (λ) : 1株当たりの配当金(過去12ヶ月の実績配当金) ÷ 前記 で定める株価

標準正規分布の累積分布関数 (N(・))

(訂正後)

新株予約権 1個当たり319円(1株当たり319円)

### (4) 発行価額の総額

(訂正前)

未定

(訂正後)

40,675,052円

・株式会社常陽銀行および株式会社足利銀行の執行役員に対して発行する新株予約権

(2) 発行数

(訂正前)

166,964個

上記の総数は割当予定数であり、引受けの申込みの数が割当予定数に満たない場合等、割り当てる本新株予約権の総数が減少したときは、割り当てる新株予約権の総数をもって発行する新株予約権の総数とする。

(訂正後)

147,282個

(3) 発行価格

(訂正前)

各新株予約権の払込金額(発行価額)は、以下の から の基礎数値に基づき、ブラック・ショールズ・モデルにより算出した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(1円未満の端数は切り上げ)とする。

$$C = Se^{-\lambda t} N(d_1) - e^{-rt} X N(d_2)$$

ここで、

$$d_1 = \frac{\ln\left(\frac{S}{X}\right) + \left(r - \lambda + \frac{\sigma^2}{2}\right)t}{\sigma\sqrt{t}}, d_2 = d_1 - \sigma\sqrt{t}$$

1株当たりのオプション価格 (C)

株価 (S) : 2018年8月13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)

行使価格 (X) : 1円

予想残存期間 (t) : 3年

ボラティリティ (σ) : 3年間(2015年8月14日から2018年8月13日まで)の各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

なお、本評価においては、株式会社常陽銀行との間で株式交換による経営統合を実施してからの期間が短いことなどから、経営統合以前の期間においては、当社と類似性の高い企業を選定のうえ、ボラティリティの算出に必要な情報量を補い算定する。

無リスクの利子率 (r) : 残存年数が予想残存期間に対応する国債の利子率

配当利回り (λ) : 1株当たりの配当金(過去12ヶ月の実績配当金) ÷ 前記 で定める株価

標準正規分布の累積分布関数 (N(⋅))

(訂正後)

新株予約権 1個当たり348円(1株当たり348円)

(4) 発行価額の総額

(訂正前)

未定

(訂正後)

51,254,136円

以上