

【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12月7日

【会社名】 株式会社第四北越フィナンシャルグループ

【英訳名】 Daishi Hokuetsu Financial Group, Inc.

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 並木富士雄

【本店の所在の場所】 長岡市大手通二丁目2番地14
(主な本社機能所在地は下記のとおりです。)
新潟市中央区東堀前通七番町1071番地1

【電話番号】 (025)224局7111番(代表)

【事務連絡者氏名】 経営企画部長 柴田 憲

【最寄りの連絡場所】 東京都中央区日本橋室町1丁目6番5号だいし東京ビル
株式会社第四銀行 東京事務所

【電話番号】 (03)3270局4444番

【事務連絡者氏名】 東京事務所長 木部 昭宏

【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 【臨時報告書の訂正報告書の提出理由】

2018年11月9日付で、金融商品取引法第24条の5第4項及び企業内容等の開示に関する内閣府令第19条第2項第2号の2の規定に基づき提出しました、ストックオプションとしての新株予約権の発行に関する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」が確定いたしましたので、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 【訂正箇所】

訂正箇所は__を付して表示しております。

2．発行数

(訂正前)

8,276個

上記発行数は割当予定数であり、申込みの数が割当予定数に満たない場合等、割り当てる新株予約権の総数が減少したときには、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)

5,044個

3．発行価格

(訂正前)

各新株予約権の発行価格は、以下の ないし 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。

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

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12月6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)：2年6ヶ月

ボラティリティ()：2年6ヶ月(2016年6月7日から2018年12月6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した株価変動率

なお本評価においては、当社普通株式が東京証券取引所に上場してからの期間が短いため、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()：1株当たりの配当金(2019年3月の予想配当金をもとに算出)÷上記 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 32,760円 (1株当たり3,276円)

4. 発行価額の総額

(訂正前)

未定

(訂正後)

165,291,880円

以上