

平成 30 年 6 月 27 日

各 位

株式会社あおぞら銀行
代表取締役社長：馬場 信輔
（コート`番号：8304）
問合せ先：経営企画部
広報室長：後藤 敦彦（電話：03(6752)1111）

株式報酬型ストック・オプション（新株予約権）の発行に関するお知らせ

当行は、本日開催の取締役会において、会社法第 236 条、第 238 条および第 240 条に基づき、当行の常勤取締役および業務執行役員に対し株式報酬型ストック・オプションとして割り当てる新株予約権を発行することを決議いたしましたので、下記のとおりお知らせいたします。

記

1. 新株予約権を発行する理由

株式報酬型ストック・オプションとしての新株予約権は、取締役および業務執行役員の業績向上と企業価値増大への貢献意欲をより強固なものとし、株主重視の経営意識を一層高めるために発行するものであります。

2. 新株予約権の発行要領

(1) 新株予約権の名称

株式会社あおぞら銀行 第 5 回株式報酬型新株予約権

(2) 新株予約権の割当ての対象者およびその人数ならびに割り当てる新株予約権の数

当行常勤取締役 4 名 1,085 個、当行業務執行役員 17 名 1,469 個

(3) 新株予約権の総数

2,554 個

上記総数は割当予定数であり、引受けの申込みがなされなかった場合等、割り当てる新株予約権の総数が減少した場合は、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。

(4) 新株予約権の目的である株式の種類および数

当行普通株式とし、新株予約権 1 個当たりの目的となる株式数は、10 株とする。

新株予約権の割当日後に、当行が普通株式の株式分割（株式無償割当てを含む。以下同じ。）または株式併合を行う場合は、新株予約権のうち、当該株式分割または株式併合の時点で行使されていない新株予約権について、次の計算式により付与株式数の調整を行い、調整により生じる 1 株未満の端数については、これを切り捨てる。

調整後付与株式数 = 調整前付与株式数 × 分割または併合の比率

また、割当日後に当行が合併、会社分割または株式交換を行う場合、その他これらの場合

に準じ付与株式数の調整を必要とする場合には、合併、会社分割または株式交換の条件等を勘案のうえ、合理的な範囲内で付与株式数は適切に調整されるものとする。

(5) 新株予約権の払込金額（発行価額）の算定方法

新株予約権の払込金額は、以下の②から⑦の基礎数値に基づき、ブラック・ショールズ・モデルにより、算出される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。

$$C = S \cdot e^{-qt} \cdot N(d_1) - X \cdot e^{-rt} \cdot N(d_2)$$

ここで

$$d_1 = \{\ln(S/X) + (r - q + \sigma^2/2)t\} / (\sigma \sqrt{t})$$

$$d_2 = d_1 - \sigma \sqrt{t}$$

- ① 1株あたりのオプション価格（C）
- ② 株価（S）：割当日の東京証券取引所における当行普通株式の普通取引の終値
（終値がない場合は、それに先立つ直近日の終値）
- ③ 行使価格（X）：1円
- ④ 予想残存期間（t）：2年
- ⑤ ボラティリティ（σ）：上記④の予想残存期間に対応する過去の連続した期間の各週最終取引日における当行普通株式の普通取引の終値に基づき算出
- ⑥ 無リスクの利率（r）：残存年数が上記④の期間に対応する国債の利率
- ⑦ 配当利回り（q）：直近年度の1株あたり配当金÷上記②に定める株価
- ⑧ 標準正規分布の累積分布関数（N（・））

なお、上記式により算出される金額は新株予約権の公正価額であり、有利発行には該当しない。

また、金銭による当該払込金額の払込みに代えて、当該新株予約権の割当てを受けた者に対して支給される当該払込金額の総額に相当する金銭報酬債権と新株予約権の払込金額の払込債務を相殺することをもって、当該新株予約権を取得させるものとする。

(6) 新株予約権の割当日

平成30年7月13日

(7) 新株予約権の行使に際して出資される財産の価額

新株予約権の行使に際して出資される財産の価額は、新株予約権の行使により発行または移転される株式1株当たりの金額を1円とし、これに付与株式数を乗じた金額とする。

(8) 新株予約権を行使することができる期間

平成30年7月14日から平成60年7月13日までとする。ただし、行使期間の最終日が当行の休業日にあたる場合は、その前営業日を最終日とする。

(9) 新株予約権の行使の条件

新株予約権者は、当行の取締役および業務執行役員のいずれの地位をも喪失した日の翌日

以降 10 日間に限り、新株予約権を一括して行使することができる。

(10) 新株予約権の譲渡制限

譲渡による新株予約権の取得については、当行の取締役会の承認を要するものとする。

(11) 新株予約権の取得に関する事項

①新株予約権者が権利行使をする前に、前記（9）の定めまたは新株予約権割当契約の定めにより新株予約権を行使できなくなった場合、当行は当行の取締役会が別途定める日をもって当該新株予約権を無償で取得することができる。

②当行が消滅会社となる合併契約、当行が分割会社となる吸収分割契約もしくは新設分割計画または当行が完全子会社となる株式交換契約もしくは株式移転計画の承認の議案が当行の株主総会（株主総会が不要な場合は当行の取締役会）において承認された場合は、当行の取締役会が別途定める日をもって、同日時点で権利行使されていない新株予約権を無償で取得することができる。

(12) 新株予約権の行使により株式を発行する場合において増加する資本金および資本準備金に関する事項

①新株予約権の行使により株式を発行する場合において増加する資本金の額は、会社計算規則第 17 条第 1 項の規定に従い算出される資本金等増加限度額の 2 分の 1 の金額とし、計算の結果 1 円未満の端数が生じたときは、その端数を切り上げるものとする。

②新株予約権の行使により株式を発行する場合において増加する資本準備金の額は、上記①記載の資本金等増加限度額から、上記①に定める増加する資本金の額を減じた金額とする。

(13) 組織再編を実施する際の新株予約権の取扱い

当行が、合併（当行が合併により消滅する場合に限る。）、吸収分割、新設分割、株式交換または株式移転（以上を総称して以下「組織再編行為」という。）をする場合において、組織再編行為の効力発生日において残存する新株予約権（以下「残存新株予約権」という。）については、会社法第 236 条第 1 項第 8 号イからホまでに掲げる株式会社（以下「再編対象会社」という。）の新株予約権を以下の条件に基づき交付することとする。この場合においては、残存新株予約権は消滅し、再編対象会社の新株予約権を新たに交付するものとする。

ただし、以下の条件に沿って再編対象会社の新株予約権を交付する旨を、合併契約、吸収分割契約、新設分割計画、株式交換契約または株式移転計画において定めた場合に限るものとする。

①交付する再編対象会社の新株予約権の数

新株予約権者が保有する残存新株予約権の数と同一の数を交付するものとする。

②新株予約権の目的となる再編対象会社の株式の種類および数

新株予約権の目的となる株式の種類は再編対象会社普通株式とし、新株予約権の行使により交付する再編対象会社普通株式の数は、組織再編行為の条件等を勘案のうえ、前記（4）に準じて決定する。

③新株予約権の行使に際して出資される財産の価額

交付される新株予約権の行使に際して出資される財産の価額は、以下に定める再編後行

使価額に当該各新株予約権の目的となる株式数を乗じて得られる金額とする。再編後行使価額は、交付される新株予約権を行使することにより交付を受けることができる再編対象会社の株式1株当たりの金額を1円とする。

④新株予約権を行使することができる期間

前記(8)に定める新株予約権を行使することができる期間の開始日と組織再編行為の効力発生日のうちいずれか遅い日から、前記(8)に定める新株予約権の行使期間の満了日までとする。

⑤新株予約権の取得に関する事項

前記(11)に準じて決定する。

⑥新株予約権の譲渡制限

譲渡による新株予約権の取得については、再編対象会社の取締役会の承認を要するものとする。

⑦新株予約権の行使により株式を発行する場合における増加する資本金及び資本準備金に関する事項

前記(12)に準じて決定する。

(14) 1株に満たない端数の処理

新株予約権者が新株予約権を行使した場合に新株予約権者に交付する株式の数に1株に満たない端数があるときには、これを切り捨てるものとする。

(15) 新株予約権の行使に際して出資される財産の払込取扱場所

東京都千代田区麴町六丁目1番地1
株式会社 あおぞら銀行 本店

以 上