【表紙】

【提出書類】	臨時報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2020年６月29日
【会社名】	東京海上ホールディングス株式会社
【英訳名】	Tokio Marine Holdings, Inc.
【代表者の役職氏名】	取締役社長　小宮　暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目２番１号
【電話番号】	03-6212-3333
【事務連絡者氏名】	法務コンプライアンス部文書グループリーダー　松浦　健二郎
【最寄りの連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目２番１号
【電話番号】	03-6212-3333
【事務連絡者氏名】	法務コンプライアンス部文書グループリーダー　松浦　健二郎
【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】

当社は、2020年６月29日開催の取締役会において、当社、当社の完全子会社である東京海上日動火災保険株式会社、日新火災海上保険株式会社および東京海上日動あんしん生命険株式会社の取締役および執行役員に対し、ストックオプションとして新株予約権を割り当てるため、会社法第238条第１項および第２項ならびに会社法第240条に従い、当該新株予約権を発行することを決議いたしましたので、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２号の２の規定に基づき本報告書を提出するものであります。

2【報告内容】

(1) 銘柄

東京海上ホールディングス株式会社2020年７月発行新株予約権（株式報酬型ストックオプション）

(2) 発行数

1,435個

上記総数は割当予定数であり、引受けの申し込みがなされなかった場合等、割り当てる募集新株予約権の総数が減少したときは、割り当てる募集新株予約権の総数をもって発行する募集新株予約権の総数とする。

(3) 発行価格

以下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各募集新株予約権の目的である株式の数を乗じた金額とする。

$$C = SN(d) - Xe^{-rT}N\left(d - \sigma\sqrt{T}\right)$$

ここで、

$$d = \frac{\ln\left(\frac{S}{X}\right) + \left(r + \frac{\sigma^2}{2}\right)T}{\sigma\sqrt{T}}$$

ⅰ 1株当たりのオプション価格（C）

ⅱ 株価（S）：2020年７月14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）－予想残存期間における予想配当額合計の現在価値

ⅲ 行使価格（X）：１円

ⅳ 予想残存期間（T）：２年

ⅴ ボラティリティ（σ）：2018年７月15日から2020年７月14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

ⅵ 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

ⅶ 標準正規分布の累積分布関数（N(・)）

(4) 発行価額の総額

未定

(5) 新株予約権の目的となる株式の種類、内容及び数

募集新株予約権の目的である株式の種類は普通株式とし、各募集新株予約権の目的である株式の数は100株とする。

ただし、割当日後、当社が当社普通株式につき、株式分割（当社普通株式の株式無償割当てを含む。以下、株式分割の記載につき同じ。）又は株式併合を行う場合には、各募集新株予約権の目的である株式の数を次の算式により調整するものとする。

調整後株式数 ＝調整前株式数 × 分割・併合の比率

調整後株式数は、株式分割の場合は、当該株式分割の基準日の翌日以降、株式併合の場合は、その効力発生日以降、これを適用する。ただし、剰余金の額を減少して資本金又は準備金を増加する議案が当社株主総会において承認されることを条件として株式分割が行われる場合で、当該株主総会の終結の日以前の日を株式分割のための基準日とする場合は、調整後株式数は、当該株主総会の終結の日の翌日以降、当該基準日の翌日に遡及してこれを適用する。

また、上記のほか、割当日後、各募集新株予約権の目的である株式の数の調整を必要とするやむを得ない事由が生じたときは、合理的な範囲で各募集新株予約権の目的である株式の数を調整する。

なお、上記の調整の結果生じる１株未満の端数は、これを切り捨てるものとする。

また、各募集新株予約権の目的である株式の数の調整を行うときは、当社は調整後株式数を適用する日の前日までに、必要な事項を新株予約権原簿に記載された各募集新株予約権を保有する者（以下、「新株予約権者」という。）

に通知又は公告する。ただし、当該適用の日の前日までに通知又は公告を行うことができない場合には、以後速やかに通知又は公告するものとする。

(6) 新株予約権の行使に際して払い込むべき金額

各募集新株予約権の行使に際して出資される財産の価額は、募集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株式１株当たりの払込金額を１円とし、これに各募集新株予約権の目的である株式の数を乗じた金額とする。

(7) 新株予約権の行使期間

2020年７月15日から2050年７月14日まで

(8) 新株予約権の行使の条件

新株予約権者である当社、東京海上日動火災保険株式会社、日新火災海上保険株式会社及び東京海上日動あんしん生命保険株式会社の取締役及び執行役員は、それぞれの会社において、取締役、監査役及び執行役員のいずれの地位をも喪失した時点以降、新株予約権を行使できる。

(9) 新株予約権の行使により株券を発行する場合の当該株券の発行価格のうちの資本組入額

ⅰ 募集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の額は、会社計算規則第17条第１項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、計算の結果生じる１円未満の端数は、これを切り上げるものとする。

ⅱ 募集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準備金の額は、上記ⅰ記載の資本金等増加限度額から上記ⅰに定める増加する資本金の額を減じた額とする。

(10) 新株予約権の譲渡に関する事項

譲渡による募集新株予約権の取得については、当社取締役会の決議による承認を要するものとする。

(11) 当該取得勧誘の相手方の人数及びその内訳

当社の取締役13名及び執行役員12名（同社の取締役との兼任者を除く）、当社の完全子会社である東京海上日動火災保険株式会社の取締役16名及び執行役員35名（同社の取締役との兼任者を除く）、当社の完全子会社である日新火災海上保険株式会社の取締役６名及び執行役員11名（同社の取締役との兼任者を除く）ならびに当社の完全子会社である東京海上日動あんしん生命保険株式会社の取締役３名及び執行役員５名、合計101名に割り当てる。

（注）当社及び主要な子会社の間における兼任者がいるため、実割当人数は88名となる。

(12) 勧誘の相手方が提出会社に関係する会社として企業内容等の開示に関する内閣府令第２条第２項に規定する会社の取締役、会計参与、執行役、監査役または使用人である場合には、当該会社と提出会社との間の関係

当社が発行済株式の総数を所有する会社

(13) 勧誘の相手方と提出会社との間の取決めの内容

新株予約権者は、本新株予約権の全部または一部につき、第三者に対して譲渡、担保権の設定、遺贈その他の処分をしないものとする。

(14) 募集新株予約権を割り当てる日

2020年７月14日

(15) 募集新株予約権と引換えにする金銭の払込の期日

払込みの期日は2020年７月14日とする。

(16) 募集新株予約権の取得条項

ⅰ 以下の(ⅰ)、(ⅱ)、(ⅲ)、(ⅳ)又は(ⅴ)の議案につき当社株主総会で承認された場合（株主総会決議が不要の場合は、当社の取締役会決議がなされた場合）は、取締役会が別途定める日に、当社は無償で募集新株予約権を取得することができる。

(ⅰ) 当社が消滅会社となる合併契約承認の議案

(ⅱ) 当社が分割会社となる分割契約又は分割計画承認の議案

(ⅲ) 当社が完全子会社となる株式交換契約又は株式移転計画承認の議案

(ⅳ) 当社の発行する全部の株式の内容として譲渡による当該株式の取得について当社の承認を要することについての定めを設ける定款の変更承認の議案

(ⅴ) 募集新株予約権の目的である株式の内容として譲渡による当該株式の取得について当社の承認を要すること又は当該種類の株式について当社が株主総会の決議によってその全部を取得することについての定めを設ける定款の変更承認の議案

ⅱ 新株予約権者である当社、東京海上日動火災保険株式会社、日新火災海上保険株式会社及び東京海上日動あんしん生命保険株式会社の取締役及び執行役員が、いずれかの会社において、取締役及び執行役員のいずれの地位をも喪失した場合は、当社は、当社代表取締役の決定により、当該新株予約権者がその喪失した地位において割当を受けた個数（当社と当該新株予約権者の間で締結する新株予約権割当契約において割当日時点で権利確

定する個数として定められた個数を除く。）に、その地位を喪失した日を含む月の翌月から2021年６月までの月数を12で除した数を乗じて得られる個数（１個未満の端数は、これを切り捨てるものとする。）の募集新株予約権を無償で取得することができる。

iii 取締役会において募集新株予約権の全部又は一部を取得する旨の決議をした場合は、当社は当該決議により取得することを定めた募集新株予約権を無償で取得することができる。

(17) 組織再編における募集新株予約権の消滅及び再編対象会社の新株予約権交付の内容に関する決定方針

当社が、合併（当社が合併により消滅する場合に限る。）、吸収分割、新設分割、株式交換又は株式移転（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の直前において残存する募集新株予約権（以下、「残存新株予約権」という。）を保有する新株予約権者に対し、それぞれの場合につき、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それぞれ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、再編対象会社は新株予約権を新たに発行するものとする。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、吸収合併契約、新設合併契約、吸収分割契約、新設分割計画、株式交換契約又は株式移転計画において定めた場合に限るものとする。

ｉ 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それぞれ交付するものとする。

ii 新株予約権の目的である再編対象会社の株式の種類

再編対象会社の普通株式とする。

iii 新株予約権の目的である再編対象会社の株式の数

組織再編行為の条件等を勘案の上、上記(5)に準じて決定する。

iv 新株予約権の行使に際して出資される財産の価額

交付される各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払込金額に上記iiiに従って決定される当該各新株予約権の目的である再編対象会社の株式の数を乗じて得られる金額とする。再編後払込金額は、交付される各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１円とする。

v 新株予約権を行使することができる期間

上記(7)に定める募集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、上記(7)に定める募集新株予約権を行使することができる期間の満了日までとする。

vi 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

上記(9)に準じて決定する。

vii 譲渡による新株予約権の取得の制限

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決議による承認を要するものとする。

viii 新株予約権の取得条項

上記(16)に準じて決定する。

ix その他の新株予約権の行使の条件

上記(8)に準じて決定する。

(18) 募集新株予約権を行使した際に生じる１株に満たない端数の取決め

募集新株予約権を行使した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場合には、これを切り捨てるものとする。

以　上