

平成 27 年 1 月 30 日

各 位

会社名 株式会社大和証券グループ本社
代表者名 執行役社長 日比野 隆司
(コード番号 8601 東証・名証(第1部))

平成 26 年 9 月末連結自己資本規制比率に関するお知らせ
(経営の健全性の状況)

金融商品取引法第 57 条の 17 の規定に基づく大和証券グループ本社の経営の健全性の状況
(平成 26 年 9 月末)について下記のとおりお知らせいたします。

記

自己資本の構成に関する開示事項

(単位 百万円, %)

項目	経過措置による不算入額	国際様式の該当番号
普通株式等Tier1資本に係る基礎項目		
普通株式に係る株主資本の額	1,008,560	1a+2-1c-26
うち、資本金及び資本剰余金の額	478,429	1a
うち、利益剰余金の額	570,737	2
うち、自己株式の額()	16,732	1c
うち、社外流出予定額()	23,874	26
うち、上記以外に該当するものの額	-	
普通株式に係る新株予約権の額	7,575	1b
その他の包括利益累計額及びその他公表準備金の額	22,302	89,208
3		
普通株式等Tier1資本に係る調整後少数株主持分の額	-	5
経過措置により普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額に算入されるものの額の合計額	69,656	
少数株主持分の額	69,656	
普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額 (イ)	1,108,094	6
普通株式等Tier1資本に係る調整項目		
無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものを除く。)の額の合計額	15,899	63,596
うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	1,741	6,967
うち、のれん及びモーゲージ・サービシング・ライツに係るもの以外のものの額	14,157	56,628
8+9		
繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	512	2,048
繰延ヘッジ損益の額	18	75
適格引当金不足額	-	-
証券化取引に伴い増加した自己資本に相当する額	-	-
負債の時価評価により生じた時価評価差額であって自己資本に算入される額	-	-
退職給付に係る資産の額	-	-
自己保有普通株式(純資産の部に計上されるものを除く。)の額	78	315
意図的に保有している他の金融機関等の普通株式の額	-	-
少数出資金融機関等の普通株式の額	6,183	24,732
18		
特定項目に係る十パーセント基準超過額	-	-
うち、その他金融機関等に係る対象資本調達手段のうち普通株式に該当するものに関連するものの額	-	-
うち、無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に関連するものの額	-	-
うち、繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に関連するものの額	-	-
19+20+21		
特定項目に係る十五パーセント基準超過額	-	-
うち、その他金融機関等に係る対象資本調達手段のうち普通株式に該当するものに関連するものの額	-	-
うち、無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に関連するものの額	-	-
うち、繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に関連するものの額	-	-
22		
23		
24		
25		
その他Tier1資本不足額	-	-
27		
普通株式等Tier1資本に係る調整項目の額 (ロ)	22,654	28
普通株式等Tier1資本		
普通株式等Tier1資本の額 ((イ) - (ロ)) (ハ)	1,085,439	29

(単位 百万円, %)

項目	経過措置による不算入額	国際様式の該当番号
その他Tier1資本に係る基礎項目		
その他Tier1資本調達手段に係る株主資本の額及びその内訳	-	31a
その他Tier1資本調達手段に係る新株予約権の額	-	31b
その他Tier1資本調達手段に係る負債の額	-	32
特別目的会社等の発行するその他Tier1資本調達手段の額	-	
その他Tier1資本に係る調整後少数株主持分等の額	14,673	34-35
適格旧Tier1資本調達手段の額のうちその他Tier1資本に係る基礎項目の額に含まれる額	-	33+35
うち、最終指定親会社及び最終指定親会社の特別目的会社等の発行する資本調達手段の額	-	33
うち、最終指定親会社の連結子法人等(最終指定親会社の特別目的会社等を除く。)の発行する資本調達手段の額	-	35
経過措置によりその他Tier1資本に係る基礎項目の額に算入されるものの額の合計額	22,782	
外国為替換算調整	22,782	
その他Tier1資本に係る基礎項目の額 (二)	37,455	36
その他Tier1資本に係る調整項目		
自己保有その他Tier1資本調達手段の額	-	37
意図的に保有している他の金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額	-	38
少数出資金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額	1,643	6,572
その他金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額	-	-
経過措置によりその他Tier1資本に係る調整項目の額に算入されるものの額の合計額	6,967	
のれん	6,967	
Tier2資本不足額	-	42
その他Tier1資本に係る調整項目の額 (ホ)	8,610	43
その他Tier1資本		
その他Tier1資本の額 (二) - (ホ)	28,844	44
Tier1資本		
Tier1資本の額 ((八) + (ヘ)) (ト)	1,114,284	45
Tier2資本に係る基礎項目		
Tier2資本調達手段に係る株主資本の額及びその内訳	-	
Tier2資本調達手段に係る新株予約権の額	-	
Tier2資本調達手段に係る負債の額	-	
特別目的会社等の発行するTier2資本調達手段の額	-	
Tier2資本に係る調整後少数株主持分等の額	3,452	46
適格旧Tier2資本調達手段の額のうちTier2資本に係る基礎項目の額に含まれる額	-	47+49
うち、最終指定親会社及び最終指定親会社の特別目的会社等の発行する資本調達手段の額	-	47
うち、最終指定親会社の連結子法人等(最終指定親会社の特別目的会社等を除く。)の発行する資本調達手段の額	-	49
一般貸倒引当金Tier2算入額及び適格引当金Tier2算入額の合計額	-	50
うち、一般貸倒引当金Tier2算入額	-	50a
うち、適格引当金Tier2算入額	-	50b
経過措置によりTier2資本に係る基礎項目の額に算入されるものの額の合計額	49,535	
その他有価証券評価差額金及び繰延ヘッジ損益	49,535	
Tier2資本に係る基礎項目の額 (チ)	52,988	51

(単位 百万円, %)

項目	経過措置による不算入額	国際様式の該当番号
Tier2資本に係る調整項目		
自己保有Tier2資本調達手段の額	-	52
意図的に保有している他の金融機関等のTier2資本調達手段の額	-	53
少数出資金融機関等のTier2資本調達手段の額	7,460	54
その他金融機関等のTier2資本調達手段の額	-	55
経過措置によりTier2資本に係る調整項目の額に算入されるものの額の合計額	-	
Tier2資本に係る調整項目の額 (リ)	7,460	57
Tier2資本		
Tier2資本の額 ((チ) - (リ)) (ヌ)	45,528	58
総自己資本		
総自己資本の額 ((ト) + (ヌ)) (ル)	1,159,813	59
リスク・アセット		
経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額の合計額	119,822	
少数出資金融機関等の資本調達手段	61,144	
無形固定資産(のれんを除く。)	56,628	
繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)	2,048	
リスク・アセットの額の合計額 (ヲ)	5,172,073	60
連結自己資本規制比率		
連結普通株式等Tier1比率 ((ハ) / (ヲ))	20.9%	61
連結Tier1比率 ((ト) / (ヲ))	21.5%	62
連結総自己資本規制比率 ((ル) / (ヲ))	22.4%	63
調整項目に係る参考事項		
少数出資金融機関等の対象資本調達手段に係る調整項目不算入額	104,528	72
その他金融機関等に係る対象資本調達手段のうち普通株式に係る調整項目不算入額	48,272	73
無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライセンスに係るものに限る。)に係る調整項目不算入額	-	74
繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に係る調整項目不算入額	7,783	75
Tier2資本に係る基礎項目の額に算入される引当金に関する事項		
一般貸倒引当金の額	-	76
一般貸倒引当金に係るTier2資本算入上限額	-	77
内部格付手法採用最終指定親会社において、適格引当金の合計額から事業法人等向けエクスポージャー及びリテール向けエクスポージャーの期待損失額の合計額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-	78
適格引当金に係るTier2資本算入上限額	-	79
資本調達手段に係る経過措置に関する事項		
適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額	-	82
適格旧Tier1資本調達手段の額から適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-	83
適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額	-	84
適格旧Tier2資本調達手段の額から適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-	85

連結の範囲に関する事項

- イ 連結自己資本規制比率を算出する対象となる会社の集団（会社グループ）に属する会社と連結財務諸表提出会社として作成された連結財務諸表における連結の範囲に含まれる会社との相違点及び当該相違点の生じた原因

相違点はありません。

- ロ 会社グループのうち、連結子会社の数並びに主要な連結子会社の名称及び主要な業務の内容

連結子会社の数

49 社

主要な連結子会社の名称	主要な業務の内容
大和証券株式会社	有価証券関連業、投資助言・代理業
大和証券投資信託委託株式会社	投資運用業、投資助言・代理業
株式会社大和総研ホールディングス	子会社の統合・管理
株式会社大和証券ビジネスセンター	事務代行業
大和プロパティ株式会社	不動産賃貸業
株式会社大和ネクスト銀行	銀行業
株式会社大和総研	情報サービス業
株式会社大和総研ビジネス・イノベーション	情報サービス業
大和企業投資株式会社	投資業
大和証券エスエムビーシープリンシパル・インベストメンツ株式会社	投資業
大和PIパートナーズ株式会社	投資業
大和リアル・エステート・アセット・マネジメント株式会社	投資運用業、投資助言・代理業
大和証券オフィス投資法人	特定資産に対する投資運用
大和証券キャピタル・マーケットズヨーロッパリミテッド	有価証券関連業
大和証券キャピタル・マーケットズアジアホールディングスB.V.	子会社の統合・管理
大和証券キャピタル・マーケットズ香港リミテッド	有価証券関連業
大和証券キャピタル・マーケットズシンガポールリミテッド	有価証券関連業
大和証券キャピタル・マーケットズアメリカホールディングスInc.	子会社の統合・管理
大和証券キャピタル・マーケットズアメリカInc.	有価証券関連業

- ハ 連結自己資本規制比率告示第 9 条の規定が適用される金融業務を営む関連会社等の数並びに当該金融業務を営む関連会社等の名称、貸借対照表の総資産の額及び純資産の額並びに主要な業務の内容

比例連結の方法を適用している金融業務を営む関連法人等はありません。

- ニ 会社グループに属する会社であって会計連結範囲に含まれないもの及び会社グループに属しない会社であって会計連結範囲に含まれるものの名称、貸借対照表の総資産の額及び純資産の額並びに主要な業務の内容

該当ありません。

- ホ 会社グループ内の資金及び自己資本の移動に係る制限などの概要

グループ内の資金及び自己資本の移動に係る特別な制限等はありません。

連結自己資本規制比率告示第3条の規定に従い連結財務諸表を作成したと仮定した場合における連結貸借対照表の各科目の額及びこれらの科目が前項に定める自己資本の構成に関する開示項目のいずれに相当するかについての説明

(単位 百万円)

	会計上の 連結貸借対照表	告示第3条の規定に基づく 連結貸借対照表	自己資本の構成に 関する開示の参照番号
流動資産			
現金・預金	2,280,448	2,280,448	
預託金	316,066	316,066	
受取手形及び売掛金	15,357	15,357	
有価証券	2,763,301	2,763,301	18, 39, 54, 72, 73
トレーディング商品	7,921,881	7,921,881	16, 18, 39, 54, 72, 73
営業投資有価証券	142,786	142,786	18, 39, 54, 72, 73
投資損失引当金	36,182	36,182	
営業貸付金	253,908	253,908	
仕掛品	1,235	1,235	
信用取引資産	222,387	222,387	
有価証券担保貸付金	6,458,502	6,458,502	
立替金	25,349	25,349	
短期貸付金	550	550	
未収収益	33,031	33,031	
繰延税金資産	8,454	8,454	10, 75
その他の流動資産	465,297	465,297	
貸倒引当金	386	386	
流動資産計	20,871,992	20,871,992	
固定資産			
有形固定資産	467,322	467,322	
無形固定資産	79,496	79,496	
のれん	8,709	8,709	8
のれん以外	70,786	70,786	9
投資その他の資産	245,869	245,869	
投資有価証券	211,388	211,388	18, 39, 54, 72, 73
繰延税金資産	1,889	1,889	10, 75
上記以外	32,592	32,592	
固定資産計	792,688	792,688	
資産合計	21,664,680	21,664,680	

(単位 百万円)

	会計上の 連結貸借対照表	告示第3条の規定に基づく 連結貸借対照表	自己資本の構成に関 する開示の参照番号
負債の部			
流動負債			
支払手形及び買掛金	5,460	5,460	
トレーディング商品	5,375,968	5,375,968	
約定見返勘定	489,063	489,063	
信用取引負債	61,849	61,849	
有価証券担保借入金	7,346,022	7,346,022	
銀行業における預金	2,429,970	2,429,970	
預り金	277,840	277,840	
受入保証金	418,307	418,307	
短期借入金	864,669	864,669	
コマーシャルペーパー	280,260	280,260	
1年内償還予定の社債	225,002	225,002	
未払法人税等	8,191	8,191	
繰延税金負債	15,481	15,481	
賞与引当金	26,075	26,075	
その他の流動負債	275,255	275,255	
固定負債			
社債	1,290,729	1,290,729	
長期借入金	854,015	854,015	
繰延税金負債	20,510	20,510	
退職給付に係る負債	35,105	35,105	
訴訟損失引当金	1,868	1,868	
負ののれん	1,141	1,141	
その他の固定負債	19,337	19,337	
特別法上の準備金	3,831	3,831	
負債合計	20,325,958	20,325,958	
純資産の部			
株主資本			
資本金	247,397	247,397	1a
資本剰余金	231,032	231,032	1a
利益剰余金	570,737	570,737	2
自己株式	16,732	16,732	1c
自己株式申込証拠金	6	6	1c
株主資本合計	1,032,441	1,032,441	
その他の包括利益累計額			
その他有価証券評価差額金	110,002	110,002	
繰延ヘッジ損益	26,969	26,969	11
為替換算調整勘定	28,477	28,477	
その他の包括利益累計額	111,511	111,511	3
新株予約権	7,575	7,575	1b
少数株主持分	187,193	187,193	34-35, 48-49
純資産合計	1,338,721	1,338,721	

定量的な開示事項

1. その他金融機関等であって最終指定親会社の子法人等であるもののうち、規制上の所要自己資本を下回った会社の名称と所要自己資本を下回った額の総額

該当ありません。

2. 自己資本の充実度に関する事項

信用リスクに対する所要自己資本の額

(単位 百万円)

	平成26年9月末
資産(オン・バランス)項目	125,923
1.現金	-
2.我が国の中央政府及び中央銀行	-
3.外国の中央政府及び中央銀行	129
4.国際決済銀行等	-
5.我が国の地方公共団体	-
6.外国の中央政府等以外の公共部門	156
7.国際開発銀行	-
8.地方公共団体金融機構	1,029
9.我が国の政府関係機関	2,064
10.地方三公社	-
11.金融機関及び第一種金融商品取引業者	10,646
12.法人等	24,145
13.中小企業等及び個人 (75%のリスクウェイトを適用したもの)	-
14.抵当権付住宅ローン	-
15.不動産取得等事業	170
16.三月以上延滞等	322
17.取立未済手形	-
18.信用保証協会等による保証付	-
19.株式会社企業再生支援機構による保証付	-
20.出資等	24,119
21.上記以外	44,564
22.証券化(オリジネーターの場合)	-
23.証券化(オリジネーター以外の場合)	2,195
24.ファンド	16,379

(単位 百万円)

	平成26年9月末
オフバランス取引等項目	60,792
1.任意の時期に無条件で取消可能又は自動的に取消可能なコミットメント	-
2.原契約期間が1年以下のコミットメント	212
3.短期の貿易関連偶発債務	-
4.特定の取引に係る偶発債務	-
5.NIF又はRUF	-
6.原契約期間が1年超のコミットメント	-
7.内部格付手法におけるコミットメント	-
8.信用供与に直接的に代替する偶発債務	181
9.買戻条件付資産売却又は求償権付資産売却等	-
10.先物購入、先渡預金、部分払込株式又は部分払込債券	-
11.有価証券の貸付、預金若しくは有価証券による担保の提供	22,308
12.派生商品取引	36,494
13.長期決済期間取引	98
14.未決済取引	1,323
15.証券化エクスポージャーに係る適格流動性補完及び適格なサービサー・キャッシュ・アドバンス	-
16.上記以外のオフバランスの証券化エクスポージャー	174
CVAリスク相当額	56,879
中央清算機関 関連エクスポージャー	2,137
信用リスクに対する所要自己資本の額	245,733

(注) 内部格付手法が適用されるポートフォリオ、信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーは該当ありません。

マーケット・リスクに対する所要自己資本の額

(単位 百万円)

	平成26年9月末
標準的方式	67,482
金利リスク	52,898
株式リスク	11,517
外国為替リスク	2,117
コモディティ・リスク	0
オプション取引	-
内部モデル方式	27,234
マーケット・リスクに対する所要自己資本の額	93,784

オペレーショナル・リスクに対する所要自己資本の額

(単位 百万円)

	平成26年9月末
基礎的手法	74,247
粗利益配分方式	-
先進的計測手法	-
オペレーショナル・リスクに対する所要自己資本の額	74,247

連結総所要自己資本額

(単位 百万円)

	平成26年9月末
信用リスクに対する所要自己資本の額	245,733
マーケット・リスクに対する所要自己資本の額	93,784
オペレーショナル・リスクに対する所要自己資本の額	74,247
連結総所要自己資本の額	413,764

3. 信用リスク(信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャー及び証券化エクスポージャーを除く)に関する事項

信用リスクに関するエクスポージャーの期末残高及び主な種類別の内訳

【平成26年9月末】

(単位 百万円)

	エクスポージャーの額						うち三月以上延滞 エクスポージャー
	貸出金	レポ	デリバティブ	有価証券	その他 ^()		
日本	18,771,325	141,379	7,100,867	4,848,380	3,101,215	3,579,482	2,755
海外	9,425,765	7,537	9,087,855	51,328	9,668	269,375	357
地域別合計	28,197,090	148,916	16,188,723	4,899,708	3,110,883	3,848,857	3,112
ソブリン	4,827,232	2,915	546,138	72,976	2,402,631	1,802,569	1
金融機関	9,018,958	5,317	4,709,439	3,629,449	59,700	615,050	0
法人	5,086,163	43,562	4,153,885	503,327	249,415	135,972	3,093
個人	310,437	97,121	-	67	-	213,248	17
CCP	7,617,022	-	6,779,259	693,887	-	143,875	-
その他	1,337,277	-	-	-	399,135	938,141	-
業種別合計	28,197,090	148,916	16,188,723	4,899,708	3,110,883	3,848,857	3,112
1年以下	15,099,308	110,588	14,405,155	388,640	19,626	175,298	/
1年超3年以下	353,153	47	-	301,543	51,562	-	
3年超5年以下	1,019,630	2	-	791,348	228,230	49	
5年超7年以下	3,297,396	-	-	2,766,675	530,720	-	
7年超	1,825,075	213	-	648,543	1,176,318	-	
期間の定めのないもの	6,602,526	38,065	1,783,568	2,956	1,104,426	3,673,508	
残存期間別合計	28,197,090	148,916	16,188,723	4,899,708	3,110,883	3,848,857	

() 「その他」には預金、有形固定資産、無形固定資産等が含まれています。

一般貸倒引当金、個別貸倒引当金及び特定海外債権引当勘定の期末残高及び期中の増減額

(単位 百万円)

引当金の種類	地域	平成26年9月末	期中増減額
一般貸倒引当金		-	-
個別貸倒引当金	日本	38,210	1,289
	海外	74	3
特定海外債権引当勘定		-	-
引当金の種類	業種/取引相手		
一般貸倒引当金		-	-
個別貸倒引当金	ソブリン	-	-
	金融機関	-	-
	法人	598	79
	個人	2	3
	その他	37,683	1,210
特定海外債権引当勘定		-	-

業種別又は取引相手の別の貸出金償却の額
当期において該当ありません。

リスク・ウェイトの区分ごとの信用リスク削減手法の効果を勘案した後のエクスポージャー

(単位 百万円)

リスク・ウェイト区分	平成26年9月末		
	エクスポージャーの額		
		外部格付より リスクウェイトを 決定	左記以外
0%	4,152,327	642,005	3,510,322
2%	455,700	-	455,700
10%	165,320	-	165,320
20%	2,109,067	2,034,931	74,136
35%	-	-	-
50%	274,909	274,908	-
75%	-	-	-
100%	1,384,660	48,291	1,336,368
150%	2,481	2,027	454
250%	79,732	-	79,732
1250%	777	-	777
その他	386,623	-	386,623
合計	9,011,601	3,002,164	6,009,437

4. 信用リスク削減手法に関する事項

信用リスク削減手法が適用されたエクスポージャー

(単位 百万円)

区分	平成26年9月末
現金	8,624,208
適格債券	7,058,884
適格株式	533,166
適格投資信託	-
適格金融資産担保 計	16,216,258
保証	-
クレジット・デリバティブ	-
保証・クレジット・デリバティブ 計	-

5. 派生商品取引及び長期決済期間取引の取引相手のリスクに関する事項

与信相当額の算出は、カレントエクスポージャー方式により算出しております。

【平成 26 年 9 月末】

(単位 百万円)

	グロス再構築コスト	グロスのアドオン	与信相当額
外国為替取引	932,373	670,747	1,603,120
金利関連取引	1,244,812	725,178	1,969,991
株式関連取引	449,640	366,094	815,734
その他取引	-	-	-
クレジット・デリバティブ取引	47,185	466,057	513,242
合計 (A)	2,674,011	2,228,076	4,902,088
ネットイング契約による与信相当額削減効果 (B)			3,160,794
ネットの与信相当額 (C=A-B)			1,741,293
信用リスク削減手法効果勘案 (D)			342,422
現金			228,592
適格債券			104,793
適格株式			9,036
適格投資信託			-
担保による信用リスク削減手法勘案後のネットの与信相当額 (C-D)			1,398,870

与信相当額算出の対象となるクレジット・デリバティブの想定元本額

【平成 26 年 9 月末】

(単位 百万円)

クレジット・デリバティブの種類	想定元本額	
	プロテクション購入	プロテクション提供
クレジット・デフォルト・スワップ	2,737,541	2,686,341

信用リスク削減手法の効果を勘案するために用いているクレジット・デリバティブの想定元本額

該当ありません。

6. 証券化エクスポージャーに関する事項

イ オリジネーターである場合の信用リスク・アセットの算出対象となる証券化エクスポージャーに関する事項

該当ありません。

ロ 投資家である場合の信用リスク・アセットの算出対象となる証券化エクスポージャーに関する事項

(1) 主な原資産の種類別の内訳

【平成 26 年 9 月末】

(単位 百万円)

主な原資産の種類	エクスポージャーの額	うち1250%のリスクウェイト		
		うち再証券化		うち再証券化
債権	145,934	-	-	-
不動産	-	-	-	-
株式	-	-	-	-
その他	-	-	-	-
合計額	145,934	-	-	-

(2) リスク・ウェイト区分ごとの残高及び所要自己資本の額

【平成 26 年 9 月末】

(単位 百万円)

リスク・ウェイト区分	エクスポージャーの額	所要自己資本額		
		うち再証券化		うち再証券化
20%以下	145,934	-	2,334	-
20%超50%以下	-	-	-	-
50%超100%以下	-	-	-	-
100%超350%以下	-	-	-	-
350%超1250%未満	-	-	-	-
1250%	-	-	-	-
合計額	145,934	-	2,334	-

(3) 再証券化エクスポージャーに対する信用リスク削減手法の適用の有無及び保証人ごと又は当該保証人に適用されるリスク・ウェイトの区分ごとの内訳

該当ありません。

ハ オリジネーターである場合のマーケット・リスク相当額の算出対象となる証券化エクスポージャーに関する事項

該当ありません。

二 投資家である場合のマーケット・リスク相当額の算出対象となる証券化エクスポージャーに関する事項

(1) 主な原資産の種類別の内訳

【平成26年9月末】

(単位 百万円)

主な原資産の種類	エクスポージャーの額		うち100%のリスクウェイト	
		うち再証券化		うち再証券化
債権	8,234	-	-	-
不動産	-	-	-	-
株式	-	-	-	-
その他	-	-	-	-
合計額	8,234	-	-	-

(2) リスクウェイト区分ごとの残高及び所要自己資本の額

【平成26年9月末】

(単位 百万円)

リスク・ウェイト区分	エクスポージャーの額		所要自己資本額	
		うち再証券化		うち再証券化
3.2%以下	8,234	-	131	-
3.2%超 8%以下	-	-	-	-
8%超 18%以下	-	-	-	-
18%超 52%以下	-	-	-	-
52%超 100%未満	-	-	-	-
100%	-	-	-	-
合計額	8,234	-	131	-

(3) 包括的リスクの計測対象としている証券化エクスポージャーの総額

該当ありません。

7. マーケット・リスクに関する事項

内部モデル方式における VaR の状況は以下の通りです。

算出の前提

ヒストリカル・シミュレーション法
保有期間 10 日 信頼水準 99%

【平成 26 年 9 月末】

(単位 百万円)

	VaRの額	ストレスVaRの額
期末値	2,267	5,794
最高値	5,235	19,086
平均値	2,223	7,796
最低値	1,086	4,146

バック・テスト超過回数	0回
-------------	----

(注)バック・テスト

VaR のモデルの正確性を検証するための手法の一つであり、保有期間 1 日の VaR と日次の仮想損益を比較する方法を行っております。

バック・テスト超過回数は、所定の期間において損失額が VaR を上回った回数です。

8. トレーディング業務以外の出資等又は株式等エクスポージャーに関する事項

イ 連結貸借対照表計上額、時価及び次に掲げる事項に係る連結貸借対照表計上額

(単位 百万円)

	平成26年9月末	
	連結貸借対照表計上額	時価
上場している出資等又は株式等エクスポージャー	168,955	168,955
上記以外の出資等又は株式等エクスポージャー	88,304	

(注) 上場株式等以外の出資等エクスポージャーは市場価格がなく時価を把握することが極めて困難なため時価開示の対象外としています。

ロ 出資等又は株式等エクスポージャーの売却及び償却に伴う損益の額

(単位 百万円)

平成26年9月末		
売却益	売却損	償却
2,553	248	313

ハ 連結貸借対照表で認識され、かつ、連結損益計算書で認識されない評価損益の額

(単位 百万円)

	平成26年9月末
評価損益の額	81,781

(注) 時価のある株式等について記載しています。

ニ 連結貸借対照表及び連結損益計算書で認識されない評価損益の額

(単位 百万円)

	平成26年9月末
評価損益の額	248

(注) 時価のある関連会社株式等について記載しています。

ホ 連結自己資本規制比率告示附則第6条の規定が適用される株式等エクスポージャーの額及び株式等エクスポージャーのポートフォリオの区分ごとの額

該当ありません。

9. 信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーの額

該当ありません。

10. トレーディング業務以外の取引から生じる金利リスクに関して会社グループが内部管理上使用した金利ショックに対する損益又は経済的価値の増減額

【平成 26 年 9 月末】

トレーディング業務以外の取引から生じる金利リスクに関して

(1) 金融資産及び金融負債（銀行業務を行う子会社が保有する金融資産及び金融負債除く）

金利が 10 ベースポイント（0.1%）変動したものと想定した場合、「社債」及び「長期借入金」の時価が合計で 16 億円変動するものと把握しております。

(2) 銀行業務を行う子会社で保有する金融資産及び金融負債

銀行業務を行う子会社では、金融資産及び金融負債について、金利以外の全てのリスク変数が一定であると仮定した場合の金利変動による経済価値は、96 億円減少するものと把握しております。

自己資本調達手段に関する契約内容の概要

1	発行者	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無
3	準拠法	国内法
	規制上の取り扱い	
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	普通株式
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額	
	連結自己資本規制比率	1,008,560百万円
9	額面総額	-
10	表示される科目の区分	
	連結貸借対照表	株主資本
11	発行日	-
12	償還期限の有無	無
13	その日付	-
14	償還等を可能とする特約の有無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	-
	剰余金の配当又は利息の支払	
17	配当率又は利率の種別	変動
18	配当率又は利率	-
19	配当等停止条項の有無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無
24	転換が生じる場合	-
25	転換の範囲	-
26	転換の比率	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-
30	元本の削減に係る特約の有無	無
31	元本の削減が生じる場合	-
32	元本の削減が生じる範囲	-
33	元本回復特約の有無	-
34	その概要	-
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無
37	非充足資本要件の内容	-

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2006年7月発行新株予約権	第3回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	287百万円	1,182百万円
9	額面総額	-	-
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2006年7月1日	2006年9月4日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2026年6月30日	2016年6月23日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種類	変動	変動
18	配当率又は利率	-	-
19	配当等停止条項の有無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合	-	-
25	転換の範囲	-	-
26	転換の比率	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無	無	無
31	元本の削減が生じる場合	-	-
32	元本の削減が生じる範囲	-	-
33	元本回復特約の有無	-	-
34	その概要	-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	-	-

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2007年7月発行新株予約権	第4回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	309百万円	825百万円
9	額面総額	-	-
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2007年7月1日	2007年9月3日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2027年6月30日	2017年6月22日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種類	変動	変動
18	配当率又は利率	-	-
19	配当等停止条項の有無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合	-	-
25	転換の範囲	-	-
26	転換の比率	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無	無	無
31	元本の削減が生じる場合	-	-
32	元本の削減が生じる範囲	-	-
33	元本回復特約の有無	-	-
34	その概要	-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	-	-

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2008年7月発行新株予約権	第5回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	285百万円	690百万円
9	額面総額	-	-
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2008年7月1日	2008年9月8日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2028年6月30日	2018年6月20日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種類	変動	変動
18	配当率又は利率	-	-
19	配当等停止条項の有無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合	-	-
25	転換の範囲	-	-
26	転換の比率	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無	無	無
31	元本の削減が生じる場合	-	-
32	元本の削減が生じる範囲	-	-
33	元本回復特約の有無	-	-
34	その概要	-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	-	-

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2009年7月発行新株予約権	第6回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	343百万円	489百万円
9	額面総額	-	-
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2009年7月1日	2009年11月9日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2029年6月30日	2019年6月19日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種類	変動	変動
18	配当率又は利率	-	-
19	配当等停止条項の有無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合	-	-
25	転換の範囲	-	-
26	転換の比率	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無	無	無
31	元本の削減が生じる場合	-	-
32	元本の削減が生じる範囲	-	-
33	元本回復特約の有無	-	-
34	その概要	-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	-	-

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2010年7月発行新株予約権	第7回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	380百万円	519百万円
9	額面総額	-	-
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2010年7月1日	2010年9月1日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2030年6月30日	2020年6月25日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種類	変動	変動
18	配当率又は利率	-	-
19	配当等停止条項の有無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合	-	-
25	転換の範囲	-	-
26	転換の比率	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無	無	無
31	元本の削減が生じる場合	-	-
32	元本の削減が生じる範囲	-	-
33	元本回復特約の有無	-	-
34	その概要	-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	-	-

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2011年7月発行新株予約権	第8回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	431百万円	333百万円
9	額面総額	-	-
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2011年7月1日	2011年9月5日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2031年6月30日	2021年6月24日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種類	変動	変動
18	配当率又は利率	-	-
19	配当等停止条項の有無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合	-	-
25	転換の範囲	-	-
26	転換の比率	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無	無	無
31	元本の削減が生じる場合	-	-
32	元本の削減が生じる範囲	-	-
33	元本回復特約の有無	-	-
34	その概要	-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	-	-

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2013年2月発行新株予約権	第9回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	472百万円	462百万円
9	額面総額	-	-
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2013年2月12日	2013年2月12日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2032年6月30日	2022年6月26日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種類	変動	変動
18	配当率又は利率	-	-
19	配当等停止条項の有無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合	-	-
25	転換の範囲	-	-
26	転換の比率	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無	無	無
31	元本の削減が生じる場合	-	-
32	元本の削減が生じる範囲	-	-
33	元本回復特約の有無	-	-
34	その概要	-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	-	-

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2014年2月発行新株予約権	第10回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	386百万円	176百万円
9	額面総額	-	-
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2014年2月10日	2014年2月10日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2033年6月30日	2023年6月25日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種類	変動	変動
18	配当率又は利率	-	-
19	配当等停止条項の有無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合	-	-
25	転換の範囲	-	-
26	転換の比率	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無	無	無
31	元本の削減が生じる場合	-	-
32	元本の削減が生じる範囲	-	-
33	元本回復特約の有無	-	-
34	その概要	-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	-	-

1	発行者	大和証券オフィス投資法人
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無
3	準拠法	国内法
	規制上の取り扱い	
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額 その他Tier1資本に係る基礎項目の額、Tier2資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	その他Tier1資本に係る基礎項目の額、Tier2資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	投資口
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額	
	連結自己資本規制比率	87,783百万円
9	額面総額	-
10	表示される科目の区分	
	連結貸借対照表	少数株主持分
11	発行日	-
12	償還期限の有無	無
13	その日付	-
14	償還等を可能とする特約の有無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	-
	剰余金の配当又は利息の支払	
17	配当率又は利率の種類別	変動
18	配当率又は利率	-
19	配当等停止条項の有無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無
24	転換が生じる場合	-
25	転換の範囲	-
26	転換の比率	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-
30	元本の削減に係る特約の有無	無
31	元本の削減が生じる場合	-
32	元本の削減が生じる範囲	-
33	元本回復特約の有無	-
34	その概要	-
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無
37	非充足資本要件の内容	-

以上