

平成 28 年 4 月 28 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 (第一部))

連結自己資本規制比率及び連結レバレッジ比率に関するお知らせ

－ 経営の健全性の状況 (平成 27 年 12 月末) －

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 27 年 12 月末) について下記のとおりお知らせいたします。

記

(単位 百万円)

| | 平成 27 年 12 月末 |
|--------------------------|---------------|
| 1. 連結総自己資本規制比率 | 21.8 % |
| 2. 連結Tier1 比率 | 21.3 % |
| 3. 連結普通株式等 Tier1 比率 | 20.9 % |
| 4. 連結における総自己資本の額 | 1,196,449 |
| 5. 連結におけるTier1 資本の額 | 1,166,224 |
| 6. 連結における普通株式等Tier1 資本の額 | 1,147,272 |
| 7. 連結総所要自己資本額 | 437,363 |

8. 自己資本の構成に関する開示事項

(単位 百万円, %)

| 国際様式の 該当番号 | 項目 | 当最終指定親会社 四半期末 | 経過措置に よる不算入額 |
|--------------------------------|---|------------------|-----------------|
| 普通株式等Tier1資本に係る基礎項目 (1) | | | |
| 1a+2-1c-26 | 普通株式に係る株主資本の額 | 1,130,339 | |
| 1a | うち、資本金及び資本剰余金の額 | 479,244 | |
| 2 | うち、利益剰余金の額 | 662,628 | |
| 1c | うち、自己株式の額(△) | 11,533 | |
| 26 | うち、社外流出予定額(△) | - | |
| | うち、上記以外に該当するものの額 | - | |
| 1b | 普通株式に係る新株予約権の額 | 8,442 | |
| 3 | その他の包括利益累計額及びその他公表準備金の額 | 52,612 | 78,918 |
| 5 | 普通株式等Tier1資本に係る調整後非支配株主持分の額 | - | |
| | 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 | - | |
| | 非支配株主持分の額 | - | |
| 6 | 普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額 (イ) | 1,191,393 | |
| 普通株式等Tier1資本に係る調整項目 (2) | | | |
| 8+9 | 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 | 33,389 | 50,083 |
| 8 | うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額 | 3,428 | 5,142 |
| 9 | 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 | 29,960 | 44,941 |
| 10 | 繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額 | 88 | 132 |
| 11 | 繰延ヘッジ損益の額 | △61 | △91 |
| 12 | 適格引当金不足額 | - | - |
| 13 | 証券化取引に伴い増加した自己資本に相当する額 | - | - |
| 14 | 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 | - | - |
| 15 | 退職給付に係る資産の額 | - | - |
| 16 | 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 | 139 | 209 |
| 17 | 意図的に保有している他の金融機関等の普通株式の額 | - | - |
| 18 | 少数出資金融機関等の普通株式の額 | 10,565 | 15,848 |
| 19+20+21 | 特定項目に係る十パーセント基準超過額 | - | - |
| 19 | 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 | - | - |
| 20 | 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 | - | - |
| 21 | 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 | 特定項目に係る十五パーセント基準超過額 | - | - |
| 23 | 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 | - | - |
| 24 | 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 | - | - |
| 25 | 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 | - | - |
| 27 | その他Tier1資本不足額 | - | |
| 28 | 普通株式等Tier1資本に係る調整項目の額 (ロ) | 44,121 | |
| 普通株式等Tier1資本 | | | |
| 29 | 普通株式等Tier1資本の額 ((イ) - (ロ)) (ハ) | 1,147,272 | |

(単位 百万円, %)

| 国際様式の 該当番号 | 項目 | 当最終指定親会社 四半期末 | 経過措置に よる不算入額 |
|------------------------------|--|---|-----------------|
| その他Tier1資本に係る基礎項目 (3) | | | |
| 30 | 31a | 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 | - |
| | 31b | その他Tier1資本調達手段に係る新株予約権の額 | - |
| | 32 | その他Tier1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その他Tier1資本調達手段の額 | - |
| 34-35 | その他Tier1資本に係る調整後非支配株主持分等の額 | - | |
| 33+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 | 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 | - | |
| | 35 | 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 | - |
| | 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 | 25,395 | |
| | 外国為替換算調整 | 25,395 | |
| 36 | その他Tier1資本に係る基礎項目の額 (二) | 25,395 | |
| その他Tier1資本に係る調整項目 | | | |
| 37 | 自己保有その他Tier1資本調達手段の額 | - | - |
| 38 | 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 | - | - |
| 39 | 少数出資金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額 | 1,301 | 1,952 |
| 40 | 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 | 5,142 | |
| | のれん | 5,142 | |
| 42 | Tier2資本不足額 | - | |
| 43 | その他Tier1資本に係る調整項目の額 (ホ) | 6,444 | |
| その他Tier1資本 | | | |
| 44 | その他Tier1資本の額 ((二) - (ホ)) (ヘ) | 18,951 | |
| Tier1資本 | | | |
| 45 | Tier1資本の額 ((ハ) + (ヘ)) (ト) | 1,166,224 | |
| Tier2資本に係る基礎項目 (4) | | | |
| 46 | 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 | - | |
| 48-49 | Tier2資本に係る調整後非支配株主持分等の額 | - | |
| 47+49 | 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 | 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 | - | - |
| | 49 | 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 | - |
| 50 | 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 | - | |
| 50a | うち、一般貸倒引当金Tier2算入額 | - | |
| 50b | うち、適格引当金Tier2算入額 | - | |
| | 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 | 36,663 | |
| | その他有価証券評価差額金及び繰延ヘッジ損益 | 36,663 | |
| 51 | Tier2資本に係る基礎項目の額 (チ) | 36,663 | |

(単位 百万円, %)

| 国際様式の 該当番号 | 項目 | 当最終指定親会社 四半期末 | 経過措置に よる不算入額 |
|--|--|------------------|-----------------|
| Tier2資本に係る調整項目 | | | |
| 52 | 自己保有Tier2資本調達手段の額 | - | - |
| 53 | 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 | - | - |
| 54 | 少数出資金融機関等のTier2資本調達手段の額 | 6,438 | 9,657 |
| 55 | その他金融機関等のTier2資本調達手段の額 | - | - |
| | 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 | - | |
| 57 | Tier2資本に係る調整項目の額 (リ) | 6,438 | |
| Tier2資本 | | | |
| 58 | Tier2資本の額 ((チ) - (リ)) (ヌ) | 30,225 | |
| 総自己資本 | | | |
| 59 | 総自己資本の額 ((ト) + (ヌ)) (ル) | 1,196,449 | |
| リスク・アセット (5) | | | |
| | 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 | 72,531 | |
| | 少数出資金融機関等の資本調達手段 | 27,457 | |
| | 無形固定資産(のれんを除く。) | 44,941 | |
| | 繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。) | 132 | |
| 60 | リスク・アセットの額の合計額 (ヲ) | 5,467,048 | |
| 連結自己資本規制比率 | | | |
| 61 | 連結普通株式等Tier1比率 ((ハ) / (ヲ)) | 20.9% | |
| 62 | 連結Tier1比率 ((ト) / (ヲ)) | 21.3% | |
| 63 | 連結総自己資本規制比率 ((ル) / (ヲ)) | 21.8% | |
| 調整項目に係る参考事項 (6) | | | |
| 72 | 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 | 118,642 | |
| 73 | 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 | 37,181 | |
| 74 | 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。)に係る調整項目不算入額 | - | |
| 75 | 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 | 6,753 | |
| 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 (7) | | | |
| 76 | 一般貸倒引当金の額 | - | |
| 77 | 一般貸倒引当金に係るTier2資本算入上限額 | - | |
| 78 | 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。) | - | |
| 79 | 適格引当金に係るTier2資本算入上限額 | - | |
| 資本調達手段に係る経過措置に関する事項 (8) | | | |
| 82 | 適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額 | - | |
| 83 | 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。) | - | |
| 84 | 適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額 | - | |
| 85 | 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。) | - | |

9. 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)

| 自己資本の構成に関する開示の参照番号 | | 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 |
|------------------------|-----------|-----------------|-------------------------|
| | 資産の部 | | |
| | 流動資産 | | |
| | 現金・預金 | 3,427,408 | 3,427,408 |
| | 預託金 | 360,264 | 360,264 |
| | 受取手形及び売掛金 | 16,364 | 16,364 |
| 18, 39, 54, 72, 73 | 有価証券 | 2,259,662 | 2,259,662 |
| 16, 18, 39, 54, 72, 73 | トレーディング商品 | 8,243,934 | 8,243,934 |
| 18, 39, 54, 72, 73 | 営業投資有価証券 | 118,704 | 118,704 |
| | 投資損失引当金 | △ 10,959 | △ 10,959 |
| | 営業貸付金 | 423,826 | 423,826 |
| | 仕掛品 | 1,271 | 1,271 |
| | 信用取引資産 | 240,705 | 240,705 |
| | 有価証券担保貸付金 | 6,868,596 | 6,868,596 |
| | 立替金 | 12,666 | 12,666 |
| | 短期貸付金 | 447 | 447 |
| | 未収収益 | 32,485 | 32,485 |
| 10, 75 | 繰延税金資産 | 4,975 | 4,975 |
| | その他の流動資産 | 437,154 | 437,154 |
| | 貸倒引当金 | △ 348 | △ 348 |
| | 流動資産計 | 22,437,160 | 22,437,160 |
| | 固定資産 | | |
| | 有形固定資産 | 123,247 | 123,247 |
| | 無形固定資産 | 83,472 | 83,472 |
| 8 | のれん | 8,570 | 8,570 |
| 9 | のれん以外 | 74,902 | 74,902 |
| | 投資その他の資産 | 382,878 | 382,878 |
| 18, 39, 54, 72, 73 | 投資有価証券 | 350,712 | 350,712 |
| 10, 75 | 繰延税金資産 | 1,999 | 1,999 |
| | 上記以外 | 30,165 | 30,165 |
| | 固定資産計 | 589,599 | 589,599 |
| | 資産合計 | 23,026,759 | 23,026,759 |

(単位 百万円)

| 自己資本の構成に関する開示の参照番号 | | 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 |
|--------------------|--------------|-----------------|-------------------------|
| | 負債の部 | | |
| | 流動負債 | | |
| | 支払手形及び買掛金 | 5,231 | 5,231 |
| | トレーディング商品 | 5,185,972 | 5,185,972 |
| | 約定見返勘定 | 571,556 | 571,556 |
| | 信用取引負債 | 39,859 | 39,859 |
| | 有価証券担保借入金 | 7,845,435 | 7,845,435 |
| | 銀行業における預金 | 3,169,123 | 3,169,123 |
| | 預り金 | 342,286 | 342,286 |
| | 受入保証金 | 524,904 | 524,904 |
| | 短期借入金 | 959,050 | 959,050 |
| | コマーシャルペーパー | 279,650 | 279,650 |
| | 1年内償還予定の社債 | 244,842 | 244,842 |
| | 未払法人税等 | 29,937 | 29,937 |
| | 繰延税金負債 | 4,070 | 4,070 |
| | 賞与引当金 | 19,854 | 19,854 |
| | その他の流動負債 | 244,070 | 244,070 |
| | 固定負債 | | |
| | 社債 | 1,185,736 | 1,185,736 |
| | 長期借入金 | 943,363 | 943,363 |
| | 繰延税金負債 | 27,058 | 27,058 |
| | 退職給付に係る負債 | 37,877 | 37,877 |
| | 訴訟損失引当金 | 1,945 | 1,945 |
| | その他の固定負債 | 6,404 | 6,404 |
| | 特別法上の準備金 | 3,928 | 3,928 |
| | 負債合計 | 21,672,161 | 21,672,161 |
| | 純資産の部 | | |
| | 株主資本 | | |
| 1a | 資本金 | 247,397 | 247,397 |
| 1a | 資本剰余金 | 231,847 | 231,847 |
| 2 | 利益剰余金 | 662,628 | 662,628 |
| 1c | 自己株式 | △ 11,533 | △ 11,533 |
| 1c | 自己株式申込証拠金 | 0 | 0 |
| | 株主資本合計 | 1,130,340 | 1,130,340 |
| | その他の包括利益累計額 | | |
| | その他有価証券評価差額金 | 111,856 | 111,856 |
| 11 | 繰延ヘッジ損益 | △ 22,652 | △ 22,652 |
| | 為替換算調整勘定 | 42,326 | 42,326 |
| 3 | その他の包括利益累計額 | 131,530 | 131,530 |
| 1b | 新株予約権 | 8,442 | 8,442 |
| 34-35, 48-49 | 非支配株主持分 | 84,285 | 84,285 |
| | 純資産合計 | 1,354,598 | 1,354,598 |

10. 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 | 1,130,339百万円 |
| 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類 | 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 | 平成三十四年三月三十一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 | 253百万円 | 1,172百万円 |
| 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別 | 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、最も劣後の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 | 平成三十四年三月三十一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 | 274百万円 | 819百万円 |
| 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別 | 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 | 平成三十四年三月三十一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 | 262百万円 | 642百万円 |
| 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別 | 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 | 平成三十四年三月三十一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 | 323百万円 | 327百万円 |
| 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別 | 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 | 平成三十四年三月三十一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 | 366百万円 | 356百万円 |
| 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別 | 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 | 平成三十四年三月三十一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 | 422百万円 | 468百万円 |
| 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別 | 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、最も劣後の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 | 平成三十四年三月三十一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 | 458百万円 | 808百万円 |
| 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別 | 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 | 平成三十四年三月三十一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 | 376百万円 | 508百万円 |
| 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別 | 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、最も劣後の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 | 平成三十四年三月三十一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 | 2015年2月発行新株予約権 | 第11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 | 389百万円 | 212百万円 |
| 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 | 2015年2月9日 | 2015年2月9日 |
| 12 | 償還期限の有無 | 有 | 有 |
| 13 | その日付 | 2034年6月30日 | 2024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別 | 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 | — | — |

11. 自己資本調達手段に関する契約内容の詳細

当社グループにおける自己資本調達手段は全て普通株式等のため契約内容の概要と同様の内容です。

12. 連結レバレッジ比率の構成に関する開示事項

(単位 百万円, %)

| 国際様式 (表2)の 該当番号 | 国際様式 (表1)の 該当番号 | 項目 | 平成27年12月末 | 平成27年9月末 |
|---------------------------|-----------------------|---|------------|------------|
| オン・バランス資産の額 (1) | | | | |
| 1 | | 調整項目控除前のオン・バランス資産の額 | 12,818,250 | 12,401,980 |
| 1a | 1 | 連結貸借対照表における総資産の額 | 23,026,759 | 23,183,801 |
| 1b | 2 | 連結レバレッジ比率の範囲に含まれない子法人等の資産の額(△) | 0 | 0 |
| 1c | 7 | 連結レバレッジ比率の範囲に含まれる子会社の資産の額(連結貸借対照表における総資産の額に含まれる額を除く。) | 0 | 0 |
| 1d | 3 | 連結貸借対照表における総資産の額から控除される調整項目以外の資産の額(△) | 10,208,509 | 10,781,821 |
| 2 | 7 | Tier1 資本に係る調整項目の額(△) | 50,565 | 44,994 |
| 3 | | オン・バランス資産の額 (イ) | 12,767,685 | 12,356,986 |
| デリバティブ取引等に関する額 (2) | | | | |
| 4 | | デリバティブ取引等に関する再構築コストの額 | 647,239 | 653,346 |
| 5 | | デリバティブ取引等に関するアドオンの額 | 1,163,620 | 1,143,833 |
| | | デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた証拠金の対価の額 | 211,383 | 224,344 |
| 6 | | 連結貸借対照表から控除されているデリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた証拠金の対価の額 | 0 | 0 |
| 7 | | デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた変動証拠金の対価の額のうち控除する額(△) | 104,888 | 78,646 |
| 8 | | 清算会員である最終指定親会社等が補償を義務付けられていない顧客とのトレード・エクスポージャーの額(△) | | |
| 9 | | クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額 | 2,230,502 | 2,689,060 |
| 10 | | クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額から控除した額(△) | 1,789,565 | 2,215,227 |
| 11 | 4 | デリバティブ取引等に関する額 (ロ) | 2,358,291 | 2,416,710 |
| レボ取引等に関する額 (3) | | | | |
| 12 | | レボ取引等に関する資産の額 | 8,267,795 | 8,786,479 |
| 13 | | レボ取引等に関する資産の額から控除した額(△) | 1,449,141 | 1,312,471 |
| 14 | | レボ取引等に関するカウンターパーティ・リスクのエクスポージャーの額 | 175,027 | 156,420 |
| 15 | | 代理取引のエクスポージャーの額 | | |
| 16 | 5 | レボ取引等に関する額 (ハ) | 6,993,681 | 7,630,428 |
| オフ・バランス取引に関する額 (4) | | | | |
| 17 | | オフ・バランス取引の想定元本の額 | 52,351 | 47,946 |
| 18 | | オフ・バランス取引に係るエクスポージャーの額への変換調整の額(△) | 12,110 | 8,092 |
| 19 | 6 | オフ・バランス取引に関する額 (ニ) | 40,241 | 39,854 |
| 連結レバレッジ比率 (5) | | | | |
| 20 | | 資本の額 (ホ) | 1,166,224 | 1,143,101 |
| 21 | 8 | 総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ) | 22,159,898 | 22,443,978 |
| 22 | | 連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ)) | 5.26% | 5.09% |

13. 前最終指定親会社四半期の連結レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた原因

前最終指定親会社四半期の連結レバレッジ比率との間に著しい差異はございません。

以上