

平成 29 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))

## 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 28 年 9 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 28 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, %)

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
<b>普通株式等Tier1資本に係る基礎項目 (1)</b>			
1a+2-1c-26	普通株式に係る株主資本の額	1,146,824	
1a	うち、資本金及び資本剰余金の額	479,151	
2	うち、利益剰余金の額	718,943	
1c	うち、自己株式の額(△)	29,254	
26	うち、社外流出予定額(△)	22,016	
	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	8,059	
3	その他の包括利益累計額及びその他公表準備金の額	22,083	14,722
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)	<b>1,176,967</b>	
<b>普通株式等Tier1資本に係る調整項目 (2)</b>			
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	51,787	34,525
8	うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	4,173	2,782
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	47,613	31,742
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	231	154
11	繰延ヘッジ損益の額	△195	△130
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	171	114
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	10,297	6,865
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	11,398	
28	普通株式等Tier1資本に係る調整項目の額 (ロ)	<b>73,692</b>	
<b>普通株式等Tier1資本</b>			
29	普通株式等Tier1資本の額 ((イ) - (ロ)) (ハ)	<b>1,103,274</b>	

(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
<b>その他Tier1資本に係る基礎項目</b>		(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	-	
	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	△6,540	
	外国為替換算調整	△6,540	
36	その他Tier1資本に係る基礎項目の額	(ニ)	△6,540
<b>その他Tier1資本に係る調整項目</b>			
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	2,076	1,384
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	2,782	
	のれん	2,782	
42	Tier2資本不足額	-	
43	その他Tier1資本に係る調整項目の額	(ホ)	4,858
<b>その他Tier1資本</b>			
44	その他Tier1資本の額 ((ニ) - (ホ))	(ハ)	-
<b>Tier1資本</b>			
45	Tier1資本の額 ((ハ) + (ヘ))	(ト)	1,103,274
<b>Tier2資本に係る基礎項目</b>		(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	16,207	
	その他有価証券評価差額金及び繰延ヘッジ損益	16,207	
51	Tier2資本に係る基礎項目の額	(チ)	16,207

(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
<b>Tier2資本に係る調整項目</b>			
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	8,242	5,495
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)	8,242	
<b>Tier2資本</b>			
58	Tier2資本の額 ((チ) - (リ)) (ヌ)	7,965	
<b>総自己資本</b>			
59	総自己資本の額 ((ト) + (ヌ)) (ル)	1,111,239	
<b>リスク・アセット (5)</b>			
	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	45,641	
	少数出資金融機関等の資本調達手段	13,744	
	無形固定資産(のれんを除く。)	31,742	
	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)	154	
60	リスク・アセットの額の合計額 (ヲ)	4,977,599	
<b>連結自己資本規制比率</b>			
61	連結普通株式等Tier1比率 ((ハ) / (ヲ))	22.1%	
62	連結Tier1比率 ((ト) / (ヲ))	22.1%	
63	連結総自己資本規制比率 ((ル) / (ヲ))	22.3%	
<b>調整項目に係る参考事項 (6)</b>			
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	110,502	
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	40,081	
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	12,813	
<b>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)</b>			
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	-	
<b>資本調達手段に係る経過措置に関する事項 (8)</b>			
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。)	-	

## 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

54 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
大和企业投資株式会社	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
大和証券キャピタル・マーケット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)

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	3,551,431	3,551,431
	預託金	327,521	327,521
	受取手形及び売掛金	14,567	14,567
18, 39, 54, 72, 73	有価証券	1,884,250	1,884,250
16, 18, 39, 54, 72, 73	トレーディング商品	7,028,640	7,028,640
18, 39, 54, 72, 73	営業投資有価証券	134,148	134,148
	投資損失引当金	△ 11,372	△ 11,372
	営業貸付金	486,664	486,664
	仕掛品	1,097	1,097
	信用取引資産	190,714	190,714
	有価証券担保貸付金	5,355,831	5,355,831
	立替金	16,955	16,955
	短期貸付金	658	658
	未収収益	29,841	29,841
10, 75	繰延税金資産	7,779	7,779
	その他の流動資産	452,107	452,107
	貸倒引当金	△ 645	△ 645
	流動資産計	19,470,191	19,470,191
	固定資産		
	有形固定資産	122,417	122,417
	無形固定資産	86,312	86,312
8	のれん	6,956	6,956
9	のれん以外	79,356	79,356
	投資その他の資産	342,721	342,721
18, 39, 54, 72, 73	投資有価証券	308,501	308,501
10, 75	繰延税金資産	5,420	5,420
	上記以外	28,798	28,798
	固定資産計	551,451	551,451
	資産合計	20,021,642	20,021,642

(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	5,062	5,062
	トレーディング商品	4,913,273	4,913,273
	約定見返勘定	508,631	508,631
	信用取引負債	62,626	62,626
	有価証券担保借入金	6,161,208	6,161,208
	銀行業における預金	2,814,623	2,814,623
	預り金	242,792	242,792
	受入保証金	447,058	447,058
	短期借入金	827,015	827,015
	コマーシャルペーパー	-	-
	1年内償還予定の社債	275,339	275,339
	未払法人税等	14,854	14,854
	繰延税金負債	1,623	1,623
	賞与引当金	23,389	23,389
	その他の流動負債	148,697	148,697
	固定負債		
	社債	1,257,591	1,257,591
	長期借入金	958,097	958,097
	繰延税金負債	10,706	10,706
	退職給付に係る負債	39,468	39,468
	訴訟損失引当金	1,697	1,697
	その他の固定負債	6,159	6,159
	特別法上の準備金	3,970	3,970
	負債合計	18,723,886	18,723,886
	純資産の部		
	株主資本		
1a	資本金	247,397	247,397
1a	資本剰余金	231,754	231,754
2	利益剰余金	718,943	718,943
1c	自己株式	△ 29,254	△ 29,254
1c	自己株式申込証拠金	5	5
	株主資本合計	1,168,845	1,168,845
	その他の包括利益累計額		
	その他有価証券評価差額金	85,702	85,702
11	繰延ヘッジ損益	△ 32,547	△ 32,547
	為替換算調整勘定	△ 16,350	△ 16,350
3	その他の包括利益累計額	36,805	36,805
1b	新株予約権	8,059	8,059
34-35, 48-49	非支配株主持分	84,045	84,045
	純資産合計	1,297,756	1,297,756

## 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28年9月末
資産(オン・バランス)項目	99,562
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	45
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	142
7.国際開発銀行	-
8.地方公共団体金融機構	944
9.我が国の政府関係機関	1,425
10.地方三公社	-
11.金融機関及び第一種金融商品取引業者	9,601
12.法人等	20,209
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	80
16.三月以上延滞等	11
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	26,299
21.上記以外	15,706
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)	5,823
24.ファンド	19,269



(単位 百万円)

	平成28年9月末
オフバランス取引等項目	49,299
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	66
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	137
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	17,474
12.派生商品取引	31,418
13.長期決済期間取引	26
14.未決済取引	3
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	173
CVAリスク相当額	56,546
中央清算機関 関連エクスポージャー	2,200
信用リスクに対する所要自己資本の額	207,607

(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28年9月末
標準的方式	54,187
金利リスク	42,568
株式リスク	9,003
外国為替リスク	2,498
コモディティ・リスク	0
オプション取引	-
内部モデル方式	52,720
マーケット・リスクに対する所要自己資本の額	106,907

## 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28年9月末
基礎的手法	83,692
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	83,692

連結総所要自己資本額

(単位 百万円)

	平成28年9月末
信用リスクに対する所要自己資本の額	207,607
マーケット・リスクに対する所要自己資本の額	106,907
オペレーショナル・リスクに対する所要自己資本の額	83,692
連結総所要自己資本の額	398,206

### 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28年9月末】

(単位 百万円)

	エクスポージャーの額	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	17,092,906	128,069	4,494,616	5,681,231	2,270,986	4,518,002	185
海外	9,267,504	22,603	8,896,581	106,063	7,049	235,206	12
地域別合計	26,360,411	150,673	13,391,197	5,787,295	2,278,035	4,753,208	197
ソブリン	6,438,768	5,353	1,629,224	61,028	1,660,212	3,082,950	-
金融機関	7,958,454	4,131	3,988,863	3,347,357	31,171	586,931	-
法人	5,019,366	44,166	4,309,630	389,734	154,334	121,499	186
個人	275,319	97,021	-	420	-	177,877	10
CCP	5,632,298	-	3,463,479	1,988,755	-	180,063	-
その他	1,036,202	-	-	-	432,316	603,886	-
業種別合計	26,360,411	150,673	13,391,197	5,787,295	2,278,035	4,753,208	197
1年以下	12,511,009	95,578	11,986,567	252,505	42,388	133,968	/
1年超3年以下	354,750	-	-	210,215	144,534	-	
3年超5年以下	1,567,091	-	-	1,044,084	523,007	-	
5年超7年以下	3,827,631	6	-	3,539,881	287,743	-	
7年超	1,170,035	109	-	735,450	434,475	-	
期間の定めのないもの	6,929,893	54,978	1,404,630	5,158	845,886	4,619,239	
残存期間別合計	26,360,411	150,673	13,391,197	5,787,295	2,278,035	4,753,208	

(※)「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28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	13,780	525
	海外	307	233
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	514	8
	個人	242	239
	その他	13,330	510
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28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%	4,823,397	742,131	4,081,265
2%	529,883	-	529,883
10%	124,753	-	124,753
20%	2,132,131	1,821,213	310,917
35%	-	-	-
50%	122,871	122,588	282
75%	10	-	10
100%	953,751	34,447	919,304
150%	196	89	107
250%	40,037	-	40,037
1250%	1	-	1
その他	165,970	-	165,970
合計	8,893,006	2,720,470	6,172,536

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28年9月末
現金	7,261,089
適格債券	5,760,855
適格株式	440,999
適格投資信託	-
適格金融資産担保 計	13,462,945
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28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	574,457	660,820	1,235,278
金利関連取引	2,367,701	1,227,228	3,594,929
株式関連取引	331,993	282,531	614,524
その他取引	-	-	-
クレジット・デリバティブ取引	24,694	318,469	343,163
合計 (A)	3,298,846	2,489,048	5,787,895
ネットイング契約による与信相当額削減効果 (B)			3,987,276
ネットの与信相当額 (C=A-B)			1,800,618
信用リスク削減手法効果勘案 (D)			337,594
現金			280,355
適格債券			45,848
適格株式			11,389
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)			1,463,024

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28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	1,985,397	1,911,714

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28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	374,789	-	-	-
不動産	-	-	-	-
株式	-	-	-	-
その他	-	-	-	-
合計額	374,789	-	-	-

### (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28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	374,789	-	5,996	-
20%超50%以下	-	-	-	-
50%超100%以下	-	-	-	-
100%超350%以下	-	-	-	-
350%超1250%未満	-	-	-	-
1250%	-	-	-	-
合計額	374,789	-	5,996	-

(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。

ニ 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28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	5,475	-	-	-
不動産	-	-	-	-
株式	-	-	-	-
その他	-	-	-	-
合計額	5,475	-	-	-

(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28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	5,475	-	87	-
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	5,475	-	87	-

(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 28 年 9 月末】

(単位 百万円)

	VaRの額	ストレスVaRの額
期末値	3,794	9,418
最高値	15,065	18,178
平均値	5,567	11,414
最低値	2,583	4,909

バック・テスト超過回数	2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28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	161,667	161,667
上記以外の出資等又は株式等エクスポージャー	107,095	

(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28年9月末		
売却益	売却損	償却
6,946	21	544

### 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28年9月末
評価損益の額	65,757

(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28年9月末
評価損益の額	82,651

(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 28 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 ベーシスポイント（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 39 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、22 億円減少するものと把握しております。

## 連結レバレッジ比率

### 1. 連結レバレッジ比率の構成に関する開示

(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28年9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	10,759,269	12,401,980
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	20,021,642	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(△)	9,262,373	10,781,821
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(△)	78,550	44,994
3		オン・バランス資産の額 (イ)	10,680,719	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	530,622	653,346
5		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	1,194,999	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	312,589	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(△)	158,287	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	1,911,714	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(△)	1,442,694	2,215,227
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	2,348,943	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	6,290,515	8,786,479
13		レボ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	1,068,573	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	132,816	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)	5,354,758	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	60,908	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(△)	15,459	8,092
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	45,449	39,854
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	1,103,274	1,143,101
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	18,429,869	22,443,978
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	5.98%	5.09%

### 2. 前中間事業年度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

当中間事業年度と前中間事業年度の連結レバレッジ比率の差異の原因は、分母の「総エクスポージャーの額」が4,014,109百万円減少したことによるものです。なお、「総エクスポージャーの額」の減少は、「オン・バランス資産の額」が1,676,267百万円減少したことから、「レボ取引等に関する額」が2,275,670百万円減少したことによるものです。

## 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	1,146,824百万円
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
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	2006年7月発行新株予約権
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	231百万円
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
11	発行日	2006年7月1日
12	償還期限の有無	有
13	その日付	2026年6月30日
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、最も劣後的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	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	254百万円	811百万円
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	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	238百万円	637百万円
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	313百万円	316百万円
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	355百万円	323百万円
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	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	409百万円	381百万円
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	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	453百万円	1,016百万円
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	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	372百万円	707百万円
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	386百万円
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	2016年2月発行新株予約権	第12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	385百万円	76百万円
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	2016年2月8日	2016年2月8日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2035年6月30日	2025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	—	—

以上