

平成30年7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 中田 誠司
(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30年3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30年3月末) について下記のとおりお知らせいたします。

記

目次

■ 主要な指標.....	3
■ 自己資本の構成に関する開示事項.....	4
■ 定性的な開示事項.....	7
1. 連結の範囲に関する事項.....	7
2. 自己資本の充実度に関する評価方法の概要.....	8
3. 会社グループ全体のリスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要.....	8
4. 信用リスクに関する事項.....	9
5. 信用リスク削減手法に関するリスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要（派 生商品取引及びレポ形式取引等に関連して用いられる信用リスク削減手法を除く）.....	10
6. 派生商品取引及びレポ形式の取引等の相手方に対する信用リスク（カウンターパーティ信用 リスク）に関するリスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要（カウンター パーティ信用リスクの削減手法に関するものを含む）.....	10
7. 証券化取引に係るリスクに関する事項.....	10
8. マーケット・リスクに関する事項.....	12
9. オペレーショナル・リスクに関する事項.....	13
10. 信用リスク・アセットの額の算出対象となっている出資その他これに類するエクスポージャ ー又は株式等エクスポージャーに関するリスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体 制の概要.....	14
11. 金利リスクに関する事項.....	14
12. 連結貸借対照表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かに相当 するかについての説明.....	15
13. 連結自己資本規制比率規制上のエクスポージャーの額と連結貸借対照表計上額との差異及 びその要因に関する説明.....	17
■ 定量的な開示事項.....	18
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、連結自己資本規制 比率規制上の所要自己資本を下回った会社の名称及び所要自己資本を下回った額の総額.....	18
2. 信用リスク（カウンターパーティ信用リスク及び証券化取引に係るリスクを除く）に関する 事項.....	18
3. 複数の資産及び取引を裏付とするエクスポージャーで、リスク・ウェイトを直接に判定する ことができないものの額.....	20
4. その他定量的な開示事項.....	21
■ 連結レバレッジ比率に関する開示事項.....	40
1. 連結レバレッジ比率の構成に関する開示.....	40
2. 前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.....	40
■ 自己資本調達手段に関する契約内容の概要.....	41

■ 主要な指標

【KM1】

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号		平成30年 3月末	平成29年 12月末	平成29年 9月末	平成29年 6月末	平成29年 3月末
資本						
1	普通株式等Tier1 資本の額	1,142,340	1,142,707	1,134,487	1,140,227	1,131,194
2	Tier1資本の額	1,142,340	1,142,707	1,134,487	1,140,227	1,131,194
3	総自己資本の額	1,142,340	1,142,707	1,134,487	1,140,227	1,131,194
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	5,125,879	5,257,936	5,106,753	5,043,690	4,996,323
自己資本比率						
5	連結普通株式等 Tier1比率	22.28%	21.73%	22.21%	22.60%	22.64%
6	連結Tier1比率	22.28%	21.73%	22.21%	22.60%	22.64%
7	連結総自己資本 比率	22.28%	21.73%	22.21%	22.60%	22.64%
資本バッファー						
8	資本保全バッファー 比率	1.87%	1.25%	1.25%	1.25%	1.25%
9	カウンター・シクリカル ・バッファー比率	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
10	G-SIB/D-SIBバッ ファー比率	0.37%	0.25%	0.25%	0.25%	0.25%
11	最低連結資本バッ ファー比率	2.25%	1.50%	1.50%	1.50%	1.50%
12	連結資本バッファー 比率	14.28%	13.73%	14.21%	14.60%	14.64%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャー の額	20,358,038	20,987,142	19,524,574	18,979,308	19,090,638
14	連結レバレッジ比率	5.61%	5.44%	5.81%	6.00%	5.92%

■ 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	1,185,256	
1a	うち、資本金及び資本剰余金の額	478,111	
2	うち、利益剰余金の額	785,730	
1c	うち、自己株式の額 (△)	54,306	
26	うち、社外流出予定額(△)	24,279	
	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	8,790	
3	その他の包括利益累計額及びその他公表準備金の額	63,597	-
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)	1,257,644	
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	105,776	-
8	うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	11,170	-
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	94,605	-
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	580	-
11	繰延ヘッジ損益の額	▲ 127	-
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	428	-
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	4,629	-
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	4,016	
28	普通株式等Tier1資本に係る調整項目の額 (ロ)	115,303	
普通株式等Tier1資本			
29	普通株式等Tier1資本の額 ((イ) - (ロ)) (ハ)	1,142,340	

(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	-	
	外国為替換算調整	-	
36	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 (二)	-	
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	769	-
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	-	
	のれん	-	
42	Tier2資本不足額	3,246	
43	その他Tier1資本に係る調整項目の額 (ホ)	4,016	
その他Tier1資本			
44	その他Tier1資本の額 ((二) - (ホ)) (ヘ)	-	
Tier1資本			
45	Tier1資本の額 ((ハ) + (ヘ)) (ト)	1,142,340	
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	-	
	資本調達手段に係る額	-	
	その他有価証券評価差額金及び繰延ヘッジ損益	-	
51	Tier2資本に係る基礎項目の額 (チ)	-	

(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	3,246	-
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	-	
	その他金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額	-	
57	Tier2資本に係る調整項目の額 (リ)	3,246	
Tier2資本			
58	Tier2資本の額 ((チ) - (リ)) (ヌ)	-	
総自己資本			
59	総自己資本の額 ((ト) + (ヌ)) (ル)	1,142,340	
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	-	
	少数出資金融機関等の資本調達手段	-	
	無形固定資産(のれんを除く。)	-	
	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)	-	
60	リスク・アセットの額の合計額 (7)	5,125,879	
連結自己資本規制比率			
61	連結普通株式等Tier1比率 ((ハ) / (7))	22.28%	
62	連結Tier1比率 ((ト) / (7))	22.28%	
63	連結総自己資本規制比率 ((ル) / (7))	22.28%	
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	115,098	
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	33,651	
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	12,283	
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。)	-	

■ 定性的な開示事項

1. 連結の範囲に関する事項

イ) 連結自己資本規制比率告示第 3 条の規定により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（会計連結範囲）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 59 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
株式会社大和キャピタル・ホールディングス	子会社の統合・管理
大和企業投資株式会社	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、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等の概要

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。

2. 自己資本の充実度に関する評価方法の概要

当社グループでは、自己資本の充実を図るため、「経済資本管理規程」及び「規制資本管理規程」を定め、自己資本の充実度を経済資本及び規制資本により評価しております。

(経済資本)

当社グループでは、リスクアペタイト・フレームワークに基づいて自己資本から一定のストレス状況に耐えうる資本バッファ等を考慮の上、主要なグループ会社等に対し経済資本を配賦しております。経済資本配賦の際には、グループ会社等の過去のリスク実績や業務運営方針・予算等を考慮した上で決定しております。グループ会社等が業務運営に伴い保有するリスクを計量化し、当該リスクが配賦した経済資本の範囲内に収まっていることを確認することにより、自己資本の充実度を評価しています。

(規制資本)

法令上の最低所要自己資本規制比率を上回る自己資本を確保するだけでなく、社内の警戒水準を設定してリスクに見合う十分な自己資本が確保されているかを定期的に評価しています。

(ストレス・テスト)

当社グループでは、ストレス・テストの手法を活用して、一定のストレス状況に置かれた場合の当社グループの健全性への影響等を分析し、経済資本・規制資本の観点から計画の妥当性の検証及びリスクテイク余力の把握をしています。ストレス・テストにあたっては、専門家・関連部署等による議論を交えながら、内外の環境を分析し、複数のシナリオを策定します。

3. 会社グループ全体のリスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要

当社グループでは、経営レベルでのリスクガバナンスの強化を目的に、リスクアペタイト・フレームワークを導入しています。

リスクアペタイトについては、流動性、自己資本等の観点からリスクアペタイト指標を選定し、受け入れるリスクの水準を設定し、管理・モニタリングしています。

当社グループでは、このような枠組みをリスクアペタイト・ステートメントとして文書化し、グループ内へのリスクアペタイトの浸透と経営管理態勢・リスク管理態勢の水準向上を図り、リスク文化の醸成に努めています。

また、リスクアペタイト・フレームワークに基づいて当社グループ全体のリスク管理を行う上で、リスク管理の基本方針、管理すべきリスクの種類、主要リスクごとの担当役員・所管部署等を定めた「リスク管理規程」を取締役会で決定し、次のとおり基本方針を明らかにしています。

- 1 リスク管理への経営の積極的な関与
- 2 当会社グループの保有するリスクの特性に応じたリスク管理態勢の整備
- 3 統合的なリスク管理に基づくリスク総体の把握と自己資本の充実及び流動性に係る健全性の確保
- 4 リスク管理プロセスの明確化

さらに、実効的なリスクガバナンス態勢を構築するため、「3つの防衛線」に係るガイドラインを定め、リスク管理の枠組みを整備しています。

4. 信用リスクに関する事項

イ) リスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要

当社グループのトレーディング業務における信用リスクには取引先リスクと発行体リスクがあります。

取引先リスクについては、当社グループが一取引先グループに対して許容できる与信相当額の上限を設定し、定期的にモニタリングしております。加えて、取引先リスク全体のリスク量を計測しています。また、マーケットメイクにより保有する金融商品の発行体リスクについてもリスク量をモニタリングしています。

当社グループは、商品提供や資産運用・投資を行うことに伴い、様々な商品・取引のエクスポージャーが特定の取引先グループに集中するリスクがあります。当該取引先グループの信用状況が悪化した場合、大幅な損失が発生する可能性があるため、一取引先グループに対するエクスポージャーの合計に対し限度額を設定し、定期的にモニタリングしています。

ロ) 会計上の引当て及び償却に関する基準の概要

貸付金等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法により計上しております。

また銀行子会社においては、「銀行等金融機関の資産の自己査定並びに貸倒償却及び貸倒引当金の監査に関する実務指針」（日本公認会計士協会銀行等監査特別委員会報告第4号平成24年7月4日）に規定する正常先債権及び要注意先債権に相当する債権については、一定の種類毎に分類し、予想損失率等に基づき計上しております。破綻懸念先債権に相当する債権については、債権額から担保の処分可能見込額及び保証による回収可能見込額を控除し、その残額のうち必要と認める額を計上しております。破綻先債権及び実質破綻先債権に相当する債権については、債権額から、担保の処分可能見込額及び保証による回収可能見込額を控除した残額を計上しております。全ての債権は、資産の自己査定基準に基づき、営業関連部署及び審査所管部署が資産査定を実施しております。

ハ) 標準的手法を採用した場合における、エクスポージャーの種類ごとのリスク・ウェイトの判定に使用する適格格付機関等の名称

当社グループは信用リスク・アセットの算出にあたっては「標準的手法」を採用しており、リスク・ウェイトの判定において次の格付機関を採用しております。

株式会社格付投資情報センター

株式会社日本格付研究所

5. 信用リスク削減手法に関するリスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要（派生商品取引及びレポ形式取引等に関連して用いられる信用リスク削減手法を除く）

債権保全の手段として、主に担保を利用しています。担保の種類は、原則として現金や流動性の高い有価証券となっています。担保は日次で時価評価し、エクスポージャーの変動をモニタリングしています。担保の種類別の残高もモニタリングの対象となっています。

6. 派生商品取引及びレポ形式の取引等の相手方に対する信用リスク（カウンターパーティ信用リスク）に関するリスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要（カウンターパーティ信用リスクの削減手法に関するものを含む）

派生商品取引及びレポ形式の取引においては、事前取引相手の審査が行われ、信用状況等を確認できた場合に限って与信枠が付与されます。取引が継続している間は、日次でエクスポージャーと担保時価が計算・比較され、必要に応じて担保の授受が行われています。

長期決済期間取引についても同様に、事前の審査により、与信枠が付与された相手のみが取引可能になっています。これらの取引先の与信枠は定期的に見直しが行われています。

債権保全の手段として、主に担保を利用しています。担保の種類は、原則として現金や流動性の高い有価証券となっています。担保は日次で時価評価し、エクスポージャーの変動をモニタリングしています。担保の種類別の残高もモニタリングの対象となっています。

派生商品取引及びレポ取引では、原則として相対ネットティング契約を締結しております。法的な有効性を確認できる相対ネットティング契約については信用リスク削減手法を適用しております。信用リスク削減手法については「包括的手法」を採用しております。

なお、自己の信用力の悪化により追加的に担保を提供する必要が生じますが、その金額はモニタリングの対象となっており、問題ない水準と考えております。

また、担保で保全されていない部分のエクスポージャーについては、将来の期待エクスポージャーをシミュレーションで計算する方式と、与信相当額を時価や想定元本などを用いて計算する方式を併用し、市場で観測される CDS スプレッドや社内格付と取引の残存期間に応じた引当率で引当金を計算しています。

7. 証券化取引に係るリスクに関する事項

イ) リスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要

当社グループは投資家として証券化取引に関与しており、投資及びトレーディング勘定において証券化商品を保有しております。

当該証券化商品には、市場リスクや信用リスクに加え、裏付資産、優先劣後構造、ストラクチャーに関するリスクなどがあり、独立した部署が、保有残高や信用状況について定期的なモニタリングを実施しております。

ロ)連結自己資本規制比率告示第 227 条第 4 項第 3 号から第 6 号までに規定する体制の整備及びその運用状況の概要

証券化エクスポージャーの包括的なリスク特性、その裏付資産に関する包括的なリスク特性及びパフォーマンスに係る情報、証券化取引についての構造上の特性等を把握するため、定期的に証券化エクスポージャーに関する情報をモニタリングしています。

ハ)証券化目的導管体を用いて第三者の資産に係る証券化取引を行った場合の当該証券化目的導管体の名称及び当該証券化取引に係る証券化エクスポージャーを保有しているかどうかの別並びに会社グループの子法人等(連結子法人等を除く)及び関連法人等のうち、当該会社グループが行った証券化取引(当該会社グループが証券化目的導管体を用いて行った証券化取引を含む)に係る証券化エクスポージャーを保有し、かつ、当該会社グループがその経営に関与し又は助言を提供しているものの名称

該当ありません。

ニ)契約外の信用補完等を提供している証券化目的導管体の名称及び当該証券化目的導管体ごとの当該契約外の信用補完等による自己資本への影響

該当ありません。

ホ)証券化取引に関する会計方針

証券化取引に関する金融資産及び金融負債の発生及び消滅の認識、その評価及び会計処理については、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第 10 号)等に準拠しております。

ヘ)証券化エクスポージャーの種類ごとのリスク・ウェイトの判定に使用する適格格付機関の名称

証券化エクスポージャーに関するリスク・ウェイトの判定において次の格付機関を採用しております。

株式会社格付投資情報センター

株式会社日本格付研究所

ムーディーズ・インベスターズ・サービス・インク

SP グローバル・レーティング

フィッチレーティングスリミテッド

ト)内部評価方式を用いている場合には、その概要

該当ありません。

8. マーケット・リスクに関する事項

イ) リスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要

当社グループのトレーディング業務では、損益変動の抑制のために適宜ヘッジを実施していますが、ストレス時にはヘッジが有効に機能しなくなる可能性があるため、財務状況や対象部門のビジネスプラン・予算等を勘案した上で、VaR（一定の信頼水準のもとでの最大予想損失額）及び各種ストレス・テストによる損失見積りが自己資本の範囲内に収まるように、それぞれ限度枠を設定しています。その他、ポジション、感応度等にも限度枠を設定しております。当社のリスク管理部署ではグループ全体の市場リスクの状況をモニタリングし、経営陣に日次で報告しております。

ロ) 内部モデル方式を使用する場合におけるモデルの概要及び適用範囲

当社グループでは内部モデル方式として、一定の信頼水準のもとでの最大予想損失額を示す VaR 及び一定のストレス期間のもとでの最大予想損失額を示すストレス VaR を使用しております。その際、過去のマーケットの変動をそのままシナリオとして使用するヒストリカル・シミュレーション法を採用しております。当社グループでは算出された VaR と損益を比較するバック・テストングを実施し、モデルの有効性を検証しております。また、VaR は一定期間のデータに基づいて統計的仮定により算出しているため併せて、過去の大幅なマーケット変動にもとづくシナリオや、仮想的なストレスイベントにもとづくシナリオを用いて、ストレス・テストも実施しています。

ヒストリカル・シミュレーション法の前提は、以下のとおりです。

	VaR	ストレス VaR
保有期間	10 営業日	
観測期間	過去 520 営業日	ストレス期間 260 営業日
信頼水準	99%	
ヒストリカル・データの更新頻度	日次	
ヒストリカル・データの重み付け	行わない	
リスク・ファクター間の合算	同一のヒストリカル・シミュレーション日付で合算	
価格再評価の手法	原則としてフルバリュエーション法。店頭デリバティブ等、一部の商品についてはセンシティブティ法	
リスク・ファクターの変動の捕捉	一般金利は絶対リターン、エクイティ・為替は相対リターン	

大和証券株式会社、海外子会社、株式会社大和ネクスト銀行（特定取引）の一般市場リスクについて、内部モデル方式を採用しております。

9. オペレーショナル・リスクに関する事項

イ) リスク管理の方針及び手続の概要

業務の高度化・多様化、システム化の進展等に伴い様々なリスクが生じており、オペレーショナル・リスク管理の重要性は年々高まっています。

当社グループの主要なグループ各社では、当社のオペレーショナル・リスク管理に関する規程に基づき、RCSA（リスク・コントロール・セルフアセスメント）を実施する等、適切なオペレーショナル・リスク管理を行っております。加えて、権限の厳正化、人為的ミス削減のための事務処理の機械化、業務マニュアルの整備等の必要な対策を講じており、グループ各社の事業特性に応じたオペレーショナル・リスクの削減に努めております。

ロ) オペレーショナル・リスク相当額の算出に使用する手法の名称

基礎的手法を採用しております。

10. 信用リスク・アセットの額の算出対象となっている出資その他これに類するエクスポージャー又は株式等エクスポージャーに関するリスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要

当社グループはトレーディング業務以外にも、投資業務、取引関係上の目的等で投資有価証券等を保有しております。各業務において特有のリスク特性があるため、それらに応じた市場リスク管理、信用リスク管理等の枠組みに基づきリスク量を計測する等適切な方法でリスク管理を行っております。

当社が出資する子会社については当該子会社の資産・負債等を、関連会社については当該関連会社に対する当社の出資等をリスク管理の対象とし、管理区分に応じた適切なリスク管理を行っております。

その他有価証券の時価のある株式等については連結決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は主として移動平均法により算定）、時価を把握することが極めて困難と認められるものについては移動平均法による原価法で計上しております。

11. 金利リスクに関する事項

イ) リスク管理の方針及び手続の概要

当社グループにおける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ついては、市場リスク管理の中で、経済価値の変動及び期間収益の変動を算出しております。算出結果は、グループリスクマネジメント会議において報告を行っております。

ロ) 金利リスクの算定手法の概要

主要な子会社および大和証券グループ本社の保有する金融資産および金融負債を対象として、四半期ごとに一定のストレスを想定した金利変動のショックシナリオに基づき、経済価値の変動および期間収益の変動を算出しております。なお、当社グループにおける金利リスクの影響を受ける主たる金融資産・金融負債は「発行社債」及び「長期借入金」です。

12. 連結貸借対照表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か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	3,694,283	3,694,283
	預託金	348,912	348,912
	受取手形及び売掛金	19,479	19,479
18, 39, 54, 72, 73	有価証券	987,210	987,210
16, 18, 39, 54, 72, 73	トレーディング商品	6,667,033	6,667,033
	約定見返勘定	-	-
18, 39, 54, 72, 73	営業投資有価証券	115,332	115,332
	投資損失引当金	▲ 505	▲ 505
	営業貸付金	1,442,939	1,442,939
	仕掛品	479	479
	信用取引資産	262,963	262,963
	有価証券担保貸付金	6,496,752	6,496,752
	立替金	17,549	17,549
	短期貸付金	388	388
	未収収益	35,880	35,880
10, 75	繰延税金資産	9,021	9,021
	その他の流動資産	390,020	390,020
	貸倒引当金	▲ 244	▲ 244
	流動資産計	20,487,498	20,487,498
	固定資産		
	有形固定資産	124,190	124,190
	無形固定資産	105,776	105,776
8	のれん	11,170	11,170
9	のれん以外	94,605	94,605
	投資その他の資産	424,278	424,278
18, 39, 54, 72, 73	投資有価証券	367,196	367,196
10, 75	繰延税金資産	3,843	3,843
	上記以外	53,239	53,239
	固定資産計	654,245	654,245
	繰延資産計	-	-
	資産合計	21,141,743	21,141,743

(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	7,065	7,065
	トレーディング商品	5,030,817	5,030,817
	約定見返勘定	407,184	407,184
	信用取引負債	71,344	71,344
	有価証券担保借入金	5,775,897	5,775,897
	銀行業における預金	3,388,444	3,388,444
	預り金	256,858	256,858
	受入保証金	420,039	420,039
	短期借入金	1,091,771	1,091,771
	コマーシャルペーパー	105,000	105,000
	1年内償還予定の社債	261,494	261,494
	未払法人税等	9,211	9,211
	繰延税金負債	1,099	1,099
	賞与引当金	34,862	34,862
	その他の流動負債	175,115	175,115
	固定負債		
	社債	1,315,349	1,315,349
	長期借入金	1,327,780	1,327,780
	繰延税金負債	14,805	14,805
	退職給付に係る負債	41,758	41,758
	訴訟損失引当金	24,485	24,485
	負ののれん	-	-
	その他の固定負債	6,889	6,889
	特別法上の準備金	3,945	3,945
	負債合計	19,771,223	19,771,223
	純資産の部		
	株主資本		
1a	資本金	247,397	247,397
1a	資本剰余金	230,713	230,713
2	利益剰余金	785,730	785,730
1c	自己株式	▲ 54,310	▲ 54,310
1c	自己株式申込証拠金	3	3
	株主資本合計	1,209,535	1,209,535
	その他の包括利益累計額		
	その他有価証券評価差額金	61,176	61,176
11	繰延ヘッジ損益	▲ 129	▲ 129
	為替換算調整勘定	2,550	2,550
3	その他の包括利益累計額	63,597	63,597
1b	新株予約権	8,790	8,790
34-35, 48-49	非支配株主持分	88,596	88,596
	純資産合計	1,370,520	1,370,520

13. 連結自己資本規制比率規制上のエクスポージャーの額と連結貸借対照表計上額との差異及びその要因に関する説明

差異の要因については、「定量的な開示項目」の「4. その他定量的な開示事項」における「【LI2】 連結自己資本規制上のエクスポージャーの額と連結貸借対照表計上額との差異の主な要因」の注釈をご参照ください。

■ 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、連結自己資本規制比率規制上の所要自己資本を下回った会社の名称及び所要自己資本を下回った額の総額

該当ありません。

2. 信用リスク（カウンターパーティ信用リスク及び証券化取引に係るリスクを除く）に関する事項

イ) 地域別・業種別・残存期間別エクスポージャーの区分ごとの期末残高及びそれらの主な種類別の内訳

【平成30年3月末】

(単位 百万円)

		エクスポージャーの額			
			貸出金	有価証券	その他
地域別	日本	5,604,819	751,323	973,771	3,879,725
	海外	320,531	34,892	29,153	256,484
地域別合計		5,925,350	786,216	1,002,924	4,136,210
業種別	ソブリン	4,345,865	646,375	610,979	3,088,510
	金融機関	703,002	-	30,505	672,496
	法人	294,251	130,733	63,517	100,000
	個人	-	-	-	-
	CCP	53	-	-	53
	その他	582,178	9,107	297,922	275,149
業種別合計		5,925,350	786,216	1,002,924	4,136,210
残存期間別	1年以下	274,135	95,953	125,563	52,618
	1年超3年以下	48,008	-	48,008	-
	3年超5年以下	121,696	-	121,696	-
	5年超7年以下	107,973	-	107,973	-
	7年超	265,900	-	265,900	-
	期間の定めのないもの	5,107,635	690,262	333,781	4,083,591
残存期間別合計		5,925,350	786,216	1,002,924	4,136,210

ロ)連結自己資本規制比率告示第 183 条第 1 項第 1 号から第 4 号までに掲げる事由が生じた債務者のエクスポージャーの期末残高、当該期末残高に対応して計上されている引当金の額及び当該エクスポージャーに係る償却額並びに地域別・業種別の内訳

(単位 百万円)

引当金の種類	地域	平成30年3月末	期中増減額
一般貸倒引当金		-	-
個別貸倒引当金	日本	493	▲ 12,885
	海外	205	37
特定海外債権引当勘定		-	-
引当金の種類	業種/取引相手	平成30年3月末	期中増減額
一般貸倒引当金		-	-
個別貸倒引当金	ソブリン	-	-
	金融機関	-	-
	法人	579	18
	個人	-	-
	その他	119	▲ 12,866
特定海外債権引当勘定		-	-

ハ)延滞期間別のエクスポージャーの期末残高

(単位 百万円)

		延滞エクスポージャー				
		1ヵ月未満	1ヵ月以上 2ヵ月未満	2ヵ月以上 3ヵ月未満	3ヵ月以上	
地域別	日本	92	1	10	-	80
	海外	531	132	3	-	395
地域別合計		624	134	13	-	475
業種別	ソブリン	-	-	-	-	-
	金融機関	-	-	-	-	-
	法人	624	134	13	-	475
	個人	-	-	-	-	-
	CCP	-	-	-	-	-
	その他	-	-	-	-	-
業種別合計		624	134	13	-	475

二) 経営再建又は支援を図ることを目的として貸出条件の緩和を実施した債権に係る債務者のエクスポージャーの期末残高のうち、貸出条件の緩和を実施したことに伴い、当該エクスポージャーに係る引当金の額を増加させたものの額及びそれ以外のものの額

該当ありません。

3. 複数の資産及び取引を裏付とするエクスポージャーで、リスク・ウェイトを直接に判定することができないものの額

(単位 百万円)

	エクスポージャーの額
合計	717,507

4. その他定量的な開示事項

【OV1】リスク・アセットの概要

(単位 百万円)

国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		当期末	前期末	当期末	前期末
1	信用リスク	903,175		72,254	
2	うち、標準的手法適用分	747,448		59,795	
3	うち、内部格付手法適用分	-		-	
	うち、重要な出資のエクスポージャー	-		-	
	うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー	-		-	
	その他	155,726		12,458	
4	カウンターパーティ信用リスク	1,261,575		100,926	
5	うち、SA-CCR適用分	-		-	
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	330,889		26,471	
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-		-	
	うち、CVAリスク	564,809		45,184	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	27,929		2,234	
	その他	337,948		27,035	
7	マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	-		-	
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	301,418		24,113	
	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	-		-	
11	未決済取引	391		31	
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー	138,181		11,054	
13	うち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	-		-	
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	-		-	
15	うち、標準的手法適用分	138,181		11,054	
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-		-	
16	マーケット・リスク	1,461,548		116,923	
17	うち、標準的方式適用分	860,281		68,822	
18	うち、内部モデル方式適用分	601,266		48,101	
19	オペレーショナル・リスク	1,028,878		82,310	
20	うち、基礎的手法適用分	1,028,878		82,310	
21	うち、粗利益配分手法適用分	-		-	
22	うち、先進的計測手法適用分	-		-	
23	特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー	30,709		2,456	
	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	-		-	
24	フロア調整	-		-	
25	合計	5,125,879		410,070	

【LI1】 会計上の連結範囲と連結自己資本規制上の連結範囲との間の差異及び連結貸借対照表の区分と連結自己資本規制上のリスク・カテゴリーとの対応関係

LI1 その1

(単位 百万円)

	連結貸借対照表計上額	連結自己資本規制上の連結範囲に基づく連結貸借対照表計上額	各項目に対応する帳簿価額				
			信用リスク	カウンターパーティ信用リスク	証券化エクスポージャー	マーケット・リスク	所要自己資本算定対象外の項目又は規制資本からの調整項目
資産							
1	現金・預金	3,694,283	3,694,273	-	-	218,385	-
2	預託金	348,912	348,912	-	-	16,105	-
3	受取手形及び売掛金	19,479	19,375	-	-	-	-
4	有価証券	987,210	957,191	-	18,096	424,477	-
5	トレーディング商品	6,667,033	-	2,355,646	-	6,671,802	▲ 4,769
6	約定見返勘定	-	-	-	-	-	-
7	営業投資有価証券	115,332	115,332	-	-	15,025	-
8	投資損失引当金	▲ 505	▲ 505	-	-	-	-
9	営業貸付金	1,442,939	780,887	-	662,051	528,799	-
10	仕掛品	479	479	-	-	-	-
11	信用取引資産	262,963	-	262,963	-	-	-
12	有価証券担保貸付金	6,496,752	-	7,235,571	-	2,937,968	-
13	立替金	17,549	17,548	-	-	102	-
14	短期貸付金	388	388	-	-	81	-
15	未収収益	35,880	34,990	-	-	20,297	-
16	繰延税金資産	9,021	9,021	-	-	51	-
17	その他の流動資産	390,020	170,854	202,600	-	70,406	13,417
18	貸倒引当金	▲ 244	▲ 133	-	-	-	-
19	流動資産計	20,487,498	6,148,616	10,056,782	680,147	10,903,498	8,647
20	有形固定資産	124,190	-	-	-	3,408	120,782
21	無形固定資産	105,776	-	-	-	10,113	95,663
22	のれん	11,170	-	-	-	7,079	4,091
23	のれん以外	94,605	-	-	-	3,034	91,571
24	投資その他の資産	424,278	424,355	-	-	53,601	-
25	投資有価証券	367,196	367,196	-	-	25,414	-
26	繰延税金資産	3,843	3,926	-	-	3,054	-
27	上記以外	53,239	53,232	-	-	25,133	-
28	固定資産計	654,245	424,355	-	-	67,122	216,445
29	繰延資産計	-	-	-	-	-	-
30	資産合計	21,141,743	6,572,972	10,056,782	680,147	10,970,620	225,093

(注1) 「信用リスク」の項目では、「カウンターパーティ信用リスク」及び「証券化エクスポージャー」に該当する額を除いた金額を記載しております。

(注2) 「証券化エクスポージャー」の項目では、「マーケット・リスク」に該当する額を除いた金額を記載しております。

	連結貸借対照表計上額	連結自己資本規制上の連結範囲に基づく連結貸借対照表計上額	各項目に対応する帳簿価額				
			信用リスク	カウンターパーティ信用リスク	証券化エクスポージャー	マーケット・リスク	所要自己資本算定対象外の項目又は規制資本からの調整項目
負債							
31	支払手形及び買掛金	7,065	-	-	-	-	7,065
32	トレーディング商品	5,030,817	-	2,117,532	-	5,007,437	-
33	約定見返勘定	407,184	803	18,808	-	13,909	387,572
34	信用取引負債	71,344	-	71,344	-	-	-
35	有価証券担保借入金	5,775,897	-	6,514,876	-	4,187,775	-
36	銀行業における預金	3,388,444	-	-	-	300,540	3,087,904
37	預り金	256,858	-	-	-	43,673	213,185
38	受入保証金	420,039	-	-	-	3,293	416,746
39	短期借入金	1,091,771	-	-	-	58,275	1,033,496
40	コマーシャルペーパー	105,000	-	-	-	-	105,000
41	1年以内償還予定の社債	261,494	-	-	-	-	261,494
42	未払法人税等	9,211	-	-	-	-	9,211
43	繰延税金負債	1,099	-	-	-	-	1,099
44	賞与引当金	34,862	-	-	-	11,515	23,347
45	その他の流動負債	175,115	805	16,180	-	98,125	158,002
46	社債	1,315,349	-	-	-	42,187	1,273,162
47	長期借入金	1,327,780	-	-	-	-	1,327,780
48	繰延税金負債	14,805	-	-	-	-	14,805
49	退職給付に係る負債	41,758	-	-	-	-	41,758
50	訴訟損失引当金	24,485	-	-	-	22,517	1,968
51	負ののれん	-	-	-	-	-	-
52	その他の固定負債	6,889	-	-	-	991	5,898
53	特別法上の準備金	3,945	-	-	-	-	3,945
54	負債合計	19,771,223	1,608	8,738,742	-	9,790,238	8,373,447

(注1)「信用リスク」の項目では、「カウンターパーティ信用リスク」及び「証券化エクスポージャー」に該当する額を除いた金額を記載しております。

(注2)「証券化エクスポージャー」の項目では、「マーケット・リスク」に該当する額を除いた金額を記載しております。

【LI2】 連結自己資本規制上のエクスポージャーの額と連結貸借対照表計上額との差異の主な要因

(単位 百万円)

		合計	対応する項目			
			信用リスク	カウンター パーティ 信用リスク	証券化 エクスポ ージャー	マーケット・ リスク
1	自己資本比率規制上の連結範囲に基づく資産の額	21,141,743	6,572,972	10,056,782	680,147	10,970,620
2	自己資本比率規制上の連結範囲に基づく負債の額	19,771,223	1,608	8,738,742	-	9,790,238
3	自己資本比率規制上の連結範囲に基づく資産及び負債の純額	1,370,520	6,571,363	1,318,039	680,147	1,180,382
4	オフ・バランスシートの額	167,569	15,945	151,623	-	-
5	保守的な公正価値調整による差異	-	-	-	-	-
6	ネットイングルールの相違による差異(項番2に含まれる額を除く。)	-	-	-	-	-
7	引当て及び償却を勘案することによる差異	-	-	-	-	-
8	調整項目(プルデンシャル・フィルター)による差異	-	-	-	-	-
9	カレント・エクスポージャー方式適用に伴う調整	2,966,663	-	2,966,663	-	-
10	レポ形式の取引について、ネットイング効果及び担保による信用リスク削減手法の効果の勘案による調整	14,133,866	-	14,133,866	-	-
11	その他の差異	2,637,038	226,657	▲ 180,850	▲ 10,760	-
12	自己資本比率規制上のエクスポージャーの額	14,009,083	6,706,867	2,440,750	690,908	1,180,382

(注1)「信用リスク」の項目では、「カウンターパーティ信用リスク」及び「証券化エクスポージャー」に該当する額を除いた金額を記載しております。

(注2)「証券化エクスポージャー」の項目では、「マーケット・リスク」に該当する額を除いた金額を記載しております。

(注) 差異の主な要因は以下の通りです。

- トレーディング勘定のうち、デリバティブ取引については、資産と負債との間で一定の要件の下でネットイングがなされたものが、カウンターパーティ信用リスクとマーケット・リスクに跨ってエクスポージャーとして計上されております。
- 有価証券担保貸付金(レポ形式等取引)については、(負債の)有価証券担保借入金との間で一定の要件の下でネットイングされたものがエクスポージャーとして計上されております。
- オフバランス取引のうち、信用リスクに係るエクスポージャーとして計上されている対象があります。

【CR1】資産の信用の質

(単位 百万円)

		帳簿価額の総額		引当金	ネット金額
		デフォルト した エクスポ ージャー	非 デフォルト エクスポ ージャー		
	オン・バランスシートの資産				
1	貸出金	-	786,264	48	786,216
2	有価証券(うち負債性のもの)	-	705,002	-	705,002
3	その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)	475	3,790,742	1,710	3,789,507
4	オン・バランスシートの資産の合計(1+2+3)	475	5,282,009	1,758	5,280,726
	オフ・バランスシートの資産				
5	支払承諾等	-	7,691	-	7,691
6	コミットメント等	-	25,574	-	25,574
7	オフ・バランスシートの資産の合計(5+6)	-	33,266	-	33,266
	合計				
8	合計(4+7)	475	5,315,276	1,758	5,313,993

(注)「ネット金額」の項目では、「デフォルトしたエクスポージャー」と「非デフォルトエクスポージャー」の合計額から「引当金」を差し引いた値を記載しております。

【CR3】信用リスク削減手法

(単位 百万円)

		非保全 エクスポ ージャー	保全された エクスポ ージャー	担保で保全 された エクスポ ージャー	保証で保全 された エクスポ ージャー	クレジット・ デリバティブ で保全 された エクスポ ージャー
1	貸出金	736,023	50,192	50,192	-	-
2	有価証券(負債性のもの)	705,002	-	-	-	-
3	その他オン・バランスシートの資産(負債性のもの)	3,789,508	-	-	-	-
4	合計(1+2+3)	5,230,534	50,192	50,192	-	-
5	うちデフォルトしたもの	475	-	-	-	-

【CR4】標準的手法-信用リスク・エクスポージャーと信用リスク削減手法の効果

(単位 百万円、%)

	資産クラス	CCF・信用リスク削減手法適用前のエクスポージャー		CCF・信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー		信用リスク・アセットの額	リスク・ウェイトの加重平均値(RWA density)
		オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額	オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額		
1	現金	-	-	-	-	-	-
2	日本国政府及び日本銀行向け	3,807,879	-	3,807,879	-	-	-
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	195,853	-	195,853	-	59	0.03%
4	国際決済銀行等向け	-	-	-	-	-	-
5	我が国の地方公共団体向け	35,059	-	35,059	-	-	-
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	2,409	-	2,409	-	541	22.46%
7	国際開発銀行向け	10,910	-	10,910	-	-	-
8	地方公共団体金融機構向け	28,127	-	28,127	-	5,618	19.97%
9	我が国の政府関係機関向け	265,616	-	265,616	-	29,801	11.22%
10	地方三公社向け	8	-	8	-	1	12.50%
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	702,983	19,011	702,983	3,802	152,310	21.55%
12	法人等向け	281,613	1,847	231,421	1,847	191,892	82.26%
13	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-	-	-	-
14	抵当権付住宅ローン	-	-	-	-	-	-
15	不動産取得等事業向け	9,176	12,410	9,176	8,261	17,437	100.00%
16	三月以上延滞等 (抵当権付住宅ローンを除く。)	475	-	475	-	713	150.11%
17	抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞	-	-	-	-	-	-
18	取立未済手形	-	-	-	-	-	-
19	信用保証協会等による保証付	-	-	-	-	-	-
20	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	-	-	-	-	-	-
21	出資等(重要な出資を除く。)	298,609	-	298,609	-	349,071	116.90%
22	合計	5,638,722	33,269	5,588,530	13,910	747,448	13.34%

【CR5】標準的手法-資産クラス及びリスク・ウェイト別の信用リスク・エクスポージャー

CR5 その1

(単位 百万円)

	リスク・ウェイト	信用リスク・エクスポージャーの額 (CCF・信用リスク削減手法適用後)					
		0%	10%	20%	35%	50%	75%
資産クラス							
1 現金		-	-	-	-	-	-
2 日本国政府及び日本銀行向け		3,807,879	-	-	-	-	-
3 外国の中央政府及び中央銀行向け		195,735	-	1	-	113	-
4 国際決済銀行等向け		-	-	-	-	-	-
5 我が国の地方公共団体向け		35,059	-	-	-	-	-
6 外国の中央政府等以外の公共部門向け		-	-	2,334	-	-	-
7 国際開発銀行向け		10,910	-	-	-	-	-
8 地方公共団体金融機構向け		-	72	28,054	-	-	-
9 我が国の政府関係機関向け		-	233,218	32,398	-	-	-
10 地方三公社向け		-	-	8	-	-	-
11 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け		-	-	676,781	-	26,100	-
12 法人等向け		-	-	36,620	-	24,158	-
13 中小企業等向け及び個人向け		-	-	-	-	-	-
14 抵当権付住宅ローン		-	-	-	-	-	-
15 不動産取得等事業向け		-	-	-	-	-	-
16 三月以上延滞等 (抵当権付住宅ローンを除く。)		-	-	-	-	-	-
17 抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞		-	-	-	-	-	-
18 取立未済手形		-	-	-	-	-	-
19 信用保証協会等による保証付		-	-	-	-	-	-
20 株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付		-	-	-	-	-	-
21 出資等(重要な出資を除く。)		-	-	-	-	-	-
22 合計		4,049,584	233,291	776,198	-	50,373	-

	資産クラス	信用リスク・エクスポージャーの額 (CCF・信用リスク削減手法適用後)				
		リスク・ウェイト	100%	150%	250%	1250%
1	現金	-	-	-	-	-
2	日本国政府及び日本銀行向け	-	-	-	-	3,807,879
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	2	-	-	-	195,853
4	国際決済銀行等向け	-	-	-	-	-
5	我が国の地方公共団体向け	-	-	-	-	35,059
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	74	-	-	-	2,409
7	国際開発銀行向け	-	-	-	-	10,910
8	地方公共団体金融機構向け	-	-	-	-	28,127
9	我が国の政府関係機関向け	-	-	-	-	265,616
10	地方三公社向け	-	-	-	-	8
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	3,903	-	-	-	706,785
12	法人等向け	172,489	-	-	-	233,268
13	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-	-	-
14	抵当権付住宅ローン	-	-	-	-	-
15	不動産取得等事業向け	17,437	-	-	-	17,437
16	三月以上延滞等 (抵当権付住宅ローンを除く。)	-	475	-	-	475
17	抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞	-	-	-	-	-
18	取立未済手形	-	-	-	-	-
19	信用保証協会等による保証付	-	-	-	-	-
20	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	-	-	-	-	-
21	出資等(重要な出資を除く。)	264,967	-	33,641	-	298,609
22	合計	458,875	475	33,641	-	5,602,441

【CCR1】 手法別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー額

(単位 百万円)

		再構築 コスト	アドオン	実効EPE	規制上の エクスポ ージャーの算 定に使用さ れる α	信用リスク 削減手法 適用後のエ クスポー ジャー	リスク・ア セットの額
1	SA-CCR	-	-		1.4	-	-
	カレント・エクスポージャー方式	480,436	664,416			857,287	330,889
2	期待エクスポージャー方式			-	-	-	-
3	信用リスク削減手法における簡便 手法					-	-
4	信用リスク削減手法における包括的 手法					583,366	337,948
5	エクスポージャー変動推計モデル					-	-
6	合計						668,837

【CCR2】 CVA リスクに対する資本賦課

(単位 百万円)

		信用リスク削減 手法適用後の エクスポ ージャー	リスク・アセット の額 (CVAリスク相 当額を8%で除 して得た額)
1	先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	-	-
2	(i) CVAバリュー・アット・リスクの額(乗数適用後)	-	-
3	(ii) CVAストレス・バリュー・アット・リスクの額(乗数適用後)	-	-
4	標準的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	750,831	564,809
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	750,831	564,809

【CCR3】業種別及びリスク・ウェイト別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー

CCR3 その1

(単位 百万円)

業種	リスク・ウェイト	与信相当額(信用リスク削減効果勘案後)		
		0%	10%	20%
1	日本国政府及び日本銀行向け	1,948	-	-
2	外国の中央政府及び中央銀行向け	1,564	-	-
3	国際決済銀行等向け	3,606	-	-
4	我が国の地方公共団体向け	-	-	-
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	-	48,987
6	国際開発銀行向け	5,183	-	-
7	地方公共団体金融機構向け	-	6,700	-
8	我が国の政府関係機関向け	-	5,897	-
9	地方三公社向け	-	-	-
10	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	-	-	866,713
11	法人等向け	-	-	8,393
12	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-
13	上記以外	-	-	-
14	合計	12,303	12,597	924,094

(単位 百万円)

業種	リスク・ウェイト	与信相当額(信用リスク削減効果勘案後)		
		50%	75%	100%
1	日本国政府及び日本銀行向け	-	-	-
2	外国の中央政府及び中央銀行向け	-	-	-
3	国際決済銀行等向け	-	-	-
4	我が国の地方公共団体向け	-	-	-
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け	524	-	-
6	国際開発銀行向け	-	-	-
7	地方公共団体金融機構向け	-	-	-
8	我が国の政府関係機関向け	-	-	-
9	地方三公社向け	-	-	-
10	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	198	-	-
11	法人等向け	17,074	-	473,860
12	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-
13	上記以外	-	-	-
14	合計	17,796	-	473,860

業種	リスク・ウェイト	与信相当額(信用リスク削減効果勘案後)		
		150%	その他	合計
1	日本国政府及び日本銀行向け	-	-	1,948
2	外国の中央政府及び中央銀行向け	-	-	1,564
3	国際決済銀行等向け	-	-	3,606
4	我が国の地方公共団体向け	-	-	-
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	-	49,512
6	国際開発銀行向け	-	-	5,183
7	地方公共団体金融機構向け	-	-	6,700
8	我が国の政府関係機関向け	-	-	5,897
9	地方三公社向け	-	-	-
10	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	-	-	866,911
11	法人等向け	-	-	499,328
12	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-
13	上記以外	-	-	-
14	合計	-	-	1,440,653

【CCR5】担保の内訳

(単位 百万円)

	業種	派生商品取引で使用される担保				レポ形式の取引で使用される担保	
		受入担保の公正価値		差入担保の公正価値		受入担保の公正価値	差入担保の公正価値
		分別管理されている	分別管理されていない	分別管理されている	分別管理されていない		
1	現金(国内通貨)	13,275	170,599	35,054	204,316	2,289,853	3,796,491
2	現金(その他通貨)	67,469	30,294	-	18,210	4,361,124	3,706,506
3	国内ソブリン債	10	19,175	-	7,372	2,489,471	2,074,812
4	その他ソブリン債	598	-	-	-	3,380,530	3,194,129
5	政府関係機関債	3,490	-	-	-	793,573	1,166,549
6	社債	29,081	-	-	-	44,531	183,627
7	株式	16,030	-	53,507	26	775,906	449,301
8	その他担保	3,583	-	-	-	12,309	110,428
9	合計	133,535	220,068	88,562	229,925	14,147,298	14,681,844

(注) CCR5 では信用リスク削減手法に適用される担保の額を開示しております。

【CCR6】 クレジット・デリバティブ取引のエクスポージャー

(単位 百万円)

		購入した プロテクション	提供した プロテクション
	想定元本		
1	シングルネーム・クレジット・デフォルト・スワップ	709,819	893,030
2	インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ	724,289	658,238
3	トータル・リターン・スワップ	-	-
4	クレジットオプション	-	-
5	その他のクレジット・デリバティブ	-	-
6	想定元本合計	1,434,109	1,551,269
	公正価値		
7	プラスの公正価値(資産)	517	20,381
8	マイナスの公正価値(負債)	▲ 19,078	▲ 1,781

【CCR8】 中央清算機関向けエクスポージャー

(単位 百万円)

		中央清算機関向け エクスポージャー (信用リスク削減手 法適用後)	リスク・アセットの額
1	適格中央清算機関へのエクスポージャー(合計)		27,929
2	適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー (当初証拠金を除く。)	819,245	16,384
3	(i) 派生商品取引(上場以外)	562,055	11,241
4	(ii) 派生商品取引(上場)	112,763	2,255
5	(iii) レポ形式の取引	144,426	2,888
6	(iv) クロスプロダクト・ネットリングが承認された場合 のネットリング・セット	-	-
7	分別管理されている当初証拠金	93,861	
8	分別管理されていない当初証拠金	48,552	845
9	事前拠出された清算基金	38,435	10,698
10	未拠出の清算基金	-	-
11	非適格中央清算機関へのエクスポージャー(合計)		-
12	非適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー (当初証拠金を除く。)	-	-
13	(i) 派生商品取引(上場以外)	-	-
14	(ii) 派生商品取引(上場)	-	-
15	(iii) レポ形式の取引	-	-
16	(iv) クロスプロダクト・ネットリングが承認された場合 のネットリング・セット	-	-
17	分別管理されている当初証拠金	-	
18	分別管理されていない当初証拠金	-	-
19	事前拠出された清算基金	-	-
20	未拠出の清算基金	-	-

【SEC1】原資産の種類別の証券化エクスポージャー（信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーに限る。）

(単位 百万円)

	原資産の種類	自金融機関がオリジネーター		
		資産譲渡型 証券化取引	合成型 証券化取引	小計
1	リテール(合計)	-	-	-
2	担保付住宅ローン	-	-	-
3	クレジットカード債権	-	-	-
4	その他リテールに係るエクスポージャー	-	-	-
5	再証券化	-	-	-
6	ホールセール(合計)	-	-	-
7	事業法人向けローン	-	-	-
8	商業用モーゲージ担保証券	-	-	-
9	リース債権及び売掛債権	-	-	-
10	その他のホールセール	-	-	-
11	再証券化	-	-	-

	原資産の種類	自金融機関がスポンサー		
		資産譲渡型 証券化取引	合成型 証券化取引	小計
1	リテール(合計)	-	-	-
2	担保付住宅ローン	-	-	-
3	クレジットカード債権	-	-	-
4	その他リテールに係るエクスポージャー	-	-	-
5	再証券化	-	-	-
6	ホールセール(合計)	-	-	-
7	事業法人向けローン	-	-	-
8	商業用モーゲージ担保証券	-	-	-
9	リース債権及び売掛債権	-	-	-
10	その他のホールセール	-	-	-
11	再証券化	-	-	-

	原資産の種類	自金融機関が投資家		
		資産譲渡型 証券化取引	合成型 証券化取引	小計
1	リテール(合計)	121,027	-	121,027
2	担保付住宅ローン	59,695	-	59,695
3	クレジットカード債権	550	-	550
4	その他リテールに係るエクスポージャー	60,781	-	60,781
5	再証券化	-	-	-
6	ホールセール(合計)	569,881	-	569,881
7	事業法人向けローン	-	-	-
8	商業用モーゲージ担保証券	-	-	-
9	リース債権及び売掛債権	1,526	-	1,526
10	その他のホールセール	568,355	-	568,355
11	再証券化	-	-	-

【SEC2】原資産の種類別の証券化エクスポージャー（マーケット・リスク相当額の算出対象となっている証券化エクスポージャーに限る。）

（単位 百万円）

	原資産の種類	自金融機関がオリジネーター		
		資産譲渡型 証券化取引	合成型 証券化取引	小計
1	リテール(合計)	-	-	-
2	担保付住宅ローン	-	-	-
3	クレジットカード債権	-	-	-
4	その他リテールに係るエクスポージャー	-	-	-
5	再証券化	-	-	-
6	ホールセール(合計)	2,285	-	2,285
7	事業法人向けローン	2,285	-	2,285
8	商業用モーゲージ担保証券	-	-	-
9	リース債権及び売掛債権	-	-	-
10	その他のホールセール	-	-	-
11	再証券化	-	-	-

	原資産の種類	自金融機関がスポンサー		
		資産譲渡型 証券化取引	合成型 証券化取引	小計
1	リテール(合計)	-	-	-
2	担保付住宅ローン	-	-	-
3	クレジットカード債権	-	-	-
4	その他リテールに係るエクスポージャー	-	-	-
5	再証券化	-	-	-
6	ホールセール(合計)	-	-	-
7	事業法人向けローン	-	-	-
8	商業用モーゲージ担保証券	-	-	-
9	リース債権及び売掛債権	-	-	-
10	その他のホールセール	-	-	-
11	再証券化	-	-	-

	原資産の種類	自金融機関が投資家		
		資産譲渡型 証券化取引	合成型 証券化取引	小計
1	リテール(合計)	228	-	228
2	担保付住宅ローン	228	-	228
3	クレジットカード債権	-	-	-
4	その他リテールに係るエクスポージャー	-	-	-
5	再証券化	-	-	-
6	ホールセール(合計)	-	-	-
7	事業法人向けローン	-	-	-
8	商業用モーゲージ担保証券	-	-	-
9	リース債権及び売掛債権	-	-	-
10	その他のホールセール	-	-	-
11	再証券化	-	-	-

【SEC3】信用リスク・アセットの額の算出対象となる証券化エクスポージャー及び関連する所要自己資本（自金融機関がオリジネーター又はスポンサーである場合）

該当ありません。

【SEC4】信用リスク・アセットの額の算出対象となる証券化エクスポージャー及び関連する所要自己資本（自金融機関が投資家である場合）

SEC4 その1

(単位 百万円)

		合計				
		資産譲渡型 証券化取引 (小計)	証券化			
			裏付けとなる リテール	ホール セール		
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)						
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	690,908	690,908	690,908	121,027	569,881
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
4	100%超1250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
5	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
エクスポージャーの額(算出方法別)						
6	内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
7	内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
8	標準的手法が適用される証券化エクスポージャー	690,908	690,908	690,908	121,027	569,881
9	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
信用リスク・アセットの額(算出方法別)						
10	内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
11	内部格付手法における指定関数方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
12	標準的手法により算出した信用リスク・アセット	138,181	138,181	138,181	24,205	113,976
13	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
所要自己資本の額(算出方法別)						
14	内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-
15	内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-
16	標準的手法が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	11,054	11,054	11,054	1,936	9,118
17	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-

		合計				
		資産譲渡型証券化取引(小計)			合成型証券化取引(小計)	
		再証券化	シニア	非シニア	証券化	証券化
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)						
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
4	100%超1250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
5	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
エクスポージャーの額(算出方法別)						
6	内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
7	内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
8	標準的手法が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
9	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
信用リスク・アセットの額(算出方法別)						
10	内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
11	内部格付手法における指定関数方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
12	標準的手法により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
13	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
所要自己資本の額(算出方法別)						
14	内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-
15	内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-
16	標準的手法が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-
17	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-

		合計				
		合成型証券化取引(小計)				
		証券化		再証券化		
	裏付けとなる リテール	ホールセール		シニア	非シニア	
	エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)					
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
4	100%超125%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
5	125%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
	エクスポージャーの額(算出方法別)					
6	内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
7	内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
8	標準的手法が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
9	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
	信用リスク・アセットの額(算出方法別)					
10	内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
11	内部格付手法における指定関数方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
12	標準的手法により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
13	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
	所要自己資本の額(算出方法別)					
14	内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-
15	内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-
16	標準的手法が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-
17	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-

【MR1】標準的方式によるマーケット・リスク相当額

(単位 百万円)

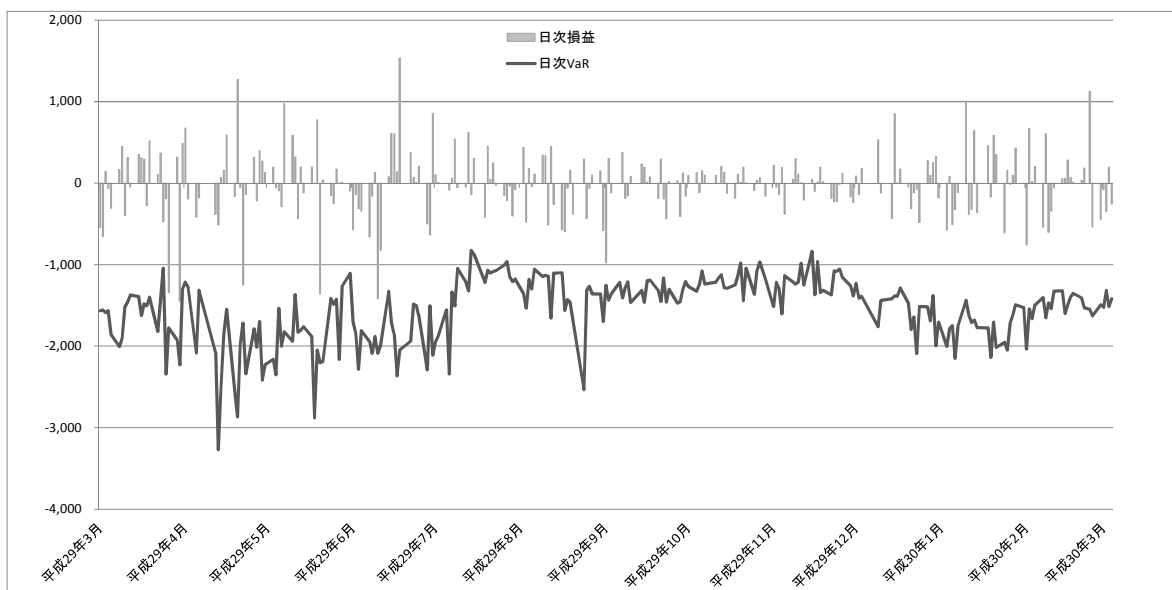
		リスク・アセット (リスク相当額を8パーセントで 除して得た額)
1	金利リスク(一般市場リスク及び個別リスク)の額	195,739
2	株式リスク(一般市場リスク及び個別リスク)の額	587,857
3	外国為替リスクの額	51,666
4	コモディティ・リスクの額	-
	オプション取引	
5	簡便法により算出した額	-
6	デルタ・プラス法により算出した額	-
7	シナリオ法により算出した額	-
8	証券化エクスポージャーに係る個別リスクの額	25,017
9	合計	860,281

【MR3】内部モデル方式の状況 (マーケット・リスク)

(単位 百万円)

	バリュー・アット・リスク(保有期間 10営業日、片側信頼区間 99%)	
1	最大値	11,018
2	平均値	4,782
3	最小値	1,546
4	期末	2,574
	ストレス・バリュー・アット・リスク(保有期間 10営業日、片側信頼区間 99%)	
5	最大値	21,025
6	平均値	9,448
7	最小値	3,930
8	期末	8,542
	追加的リスクの額(片側信頼区間 99.9%)	
9	最大値	-
10	平均値	-
11	最小値	-
12	期末	-
	包括的リスクの額(片側信頼区間 99.9%)	
13	最大値	-
14	平均値	-
15	最小値	-
16	期末	-
17	フロア(修正標準的方式)	-

【MR4】 内部モデル方式のバック・テストの結果



【IRRBB1】 金利リスク

(単位 百万円)

		△EVE	
		当期末	前期末
1	上方パラレルシフト	4,288	
2	下方パラレルシフト	30,982	
3	スティープ化	11,995	
4	フラット化	520	
5	短期金利上昇	1,563	
6	短期金利低下	28,576	
7	最大値	30,982	
		当期末	前期末
8	Tier1 資本の額	1,142,340	

(注) トレーディング業務以外から生じる金利リスクにかかる損益の変動が当社に与える影響は極めて僅少のため△NIIについては開示を省略しております。

■ 連結レバレッジ比率に関する開示事項

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30年3月末	平成29年3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	11,659,677	11,334,368
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	21,141,743	19,827,296
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(△)	-	-
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。)	-	-
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(△)	9,482,066	8,492,928
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(△)	115,303	101,137
3		オン・バランス資産の額 (イ)	11,544,374	11,233,231
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	432,448	500,144
5		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	1,310,291	1,303,547
		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	264,892	254,647
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	-	-
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(△)	118,441	125,683
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	1,551,276	1,964,204
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(△)	1,253,152	1,693,399
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	2,187,314	2,203,460
レポ取引等に関する額 (3)				
12		レポ取引等に関する資産の額	7,517,198	6,792,105
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	1,156,495	1,335,036
14		レポ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	211,873	153,878
15		代理取引のエクスポージャーの額		
16	5	レポ取引等に関する額 (ハ)	6,572,576	5,610,947
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	80,259	53,673
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(△)	26,485	10,673
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	53,774	43,000
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	1,142,340	1,131,194
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	20,358,038	19,090,638
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	5.61%	5.92%

2. 前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

当事業年度と前事業年度の連結レバレッジ比率の差異はありません。

■ 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	1,185,256 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	2007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	182 百万円	228 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	2007年7月1日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2026年6月30日	2027年6月30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	213 百万円	632 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	283 百万円	249 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	331百万円	243百万円
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	390百万円	245百万円
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	445 百万円	1,004 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	368 百万円	1,105 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	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	384百万円	733百万円
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	383百万円	249百万円
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16日	2016年2月16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	2017年2月発行新株予約権	第13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	404 百万円	240 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	2017年2月8日	2017年2月8日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2036年6月30日	2026年6月27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	2018年2月発行新株予約権	第14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	435百万円	34百万円
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	2018年2月8日	2018年2月8日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2037年6月30日	2027年6月27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	—	—

以上