

平成 23 年 12 月 1 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・大証・名証(第1部))

平成 23 年 9 月末連結自己資本規制比率に関するお知らせ
(経営の健全性の状況)

金融商品取引法第 57 条の 17 の規定に基づく大和証券グループ本社の経営の健全性の状況(平成 23 年 9 月末)について下記のとおりお知らせいたします。

記

定量的な開示事項

1. 連結自己資本規制比率告示第8条第1項第2号イから八までに掲げる控除項目の対象とする会社のうち、自己資本規制比率又はこれと類似の基準を下回った会社の名称、当該下回った額の総額

該当ありません。

2. 自己資本の構成

(単位 億円)

	期末残高
基本的項目の額 (A)	7,997
資本金	2,474
資本剰余金	2,306
利益剰余金	3,618
連結子法人等の少数株主持分	694
ステップ・アップ金利等を上乘せする特約を付す等償還を行う蓋然性を有する株式等の額	-
新株予約権	51
為替換算調整勘定	593
自己株式 ()	250
社外流出予定額 ()	51
その他有価証券の評価差損 ()	21
のれんに相当する額 ()	232
営業権(のれんを除く)に相当する額 ()	-
企業結合等により計上される無形固定資産に相当する額 ()	-
証券化取引に伴い増加した自己資本に相当する額 ()	-
(内部格付手法) 期待損失額が適格引当金を上回る額の50%相当額 ()	-
基本的項目から控除した繰延税金資産の額	-
補完的項目の額 (B)	339
準補完的項目の額 (C)	569
控除項目の額 (D)	356
自己資本の額 (E = A + B + C - D)	8,549
リスク・アセット合計 (F)	33,126
信用リスク・アセットの額	16,356
マーケット・リスク相当額を8%で除して得た額	9,953
オペレーショナル・リスク相当額を8%で除して得た額	6,817
連結自己資本規制比率 (E/F)	25.8%

3. 自己資本の充実度

信用リスクに対する所要自己資本の額

(単位 億円)

	所要自己資本の額
資産(オン・バランス)項目	868
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	2
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	1
7.国際開発銀行	-
8.地方公共団体金融機構	0
9.我が国の政府関係機関	8
10.地方三公社	0
11.金融機関及び第一種金融商品取引業者	106
12.法人等	247
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	4
16.三月以上延滞等	0
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	158
21.上記以外	213
22.証券化(オリジネーターの場合)	-
23.証券化(オリジネーター以外の場合)	2
24.ファンド	128
オフバランス取引等項目	440
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	0
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	0
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	2
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	198
12.派生商品取引	234
13.長期決済期間取引	1
14.未決済取引	5
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	-
信用リスクに対する所要自己資本の額	1,308

(注) 標準的手法を採用しており、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 億円)

	所要自己資本の額
標準的方式	633
金利リスク	468
株式リスク	144
外国為替リスク	19
コモディティ・リスク	3
オプション取引	-
内部モデル方式	163
マーケット・リスクに対する所要自己資本の額	796

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 億円)

	所要自己資本の額
基礎的手法	545
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	545

連結自己資本規制比率及び連結基本的項目比率

	比率
連結自己資本規制比率	25.8%
連結基本的項目比率	24.1%

連結総所要自己資本額

(単位 億円)

	所要自己資本の額
信用リスクに対する所要自己資本の額	1,308
マーケット・リスクに対する所要自己資本の額	796
オペレーショナル・リスクに対する所要自己資本の額	545
連結総所要自己資本の額	2,650

4. 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

(単位 億円)

	エクスポージャーの額						うち三月以上延滞 エクスポージャー
	貸出金	レボ	デリバティブ	有価証券	その他 ^()		
日本	118,665	1,068	42,530	43,699	13,562	17,806	19
海外	71,943	5	67,670	2,044	46	2,178	2
地域別合計	190,608	1,073	110,201	45,743	13,608	19,984	22
ソブリン	20,167	-	5,820	496	6,793	7,057	0
金融機関	122,241	10	74,515	40,922	938	5,856	-
法人	38,514	240	29,866	4,324	2,311	1,773	20
個人	1,967	691	-	1	-	1,275	-
その他	7,719	132	-	-	3,565	4,022	2
業種別合計	190,608	1,073	110,201	45,743	13,608	19,984	22
1年以下	101,915	792	91,825	1,155	5,979	2,165	/
1年超3年以下	1,563	130	-	1,329	104	-	
3年超5年以下	12,707	0	-	12,477	231	-	
5年超7年以下	26,592	-	-	26,529	63	-	
7年超	5,328	2	-	4,253	1,073	-	
期間の定めのないもの	42,503	150	18,376	-	6,159	17,819	
残存期間別合計	190,608	1,073	110,201	45,743	13,608	19,984	

() 「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 億円)

引当金の種類	地域	期末残高	期中増減額
一般貸倒引当金		2	30
個別貸倒引当金	日本	440	14
	海外	0	0
特定海外債権引当勘定		-	-
引当金の種類	業種/取引相手	期末残高	期中増減額
一般貸倒引当金		2	30
個別貸倒引当金	ソブリン	-	-
	金融機関	-	-
	法人	5	2
	個人	0	0
	その他	435	15
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 億円)

リスク・ウェイト区分	エクスポージャーの額		
		外部格付により リスクウェイトを 決定	左記以外
0%	12,904	519	12,385
10%	1,137	-	1,137
20%	20,400	20,205	195
35%	-	-	-
50%	2,226	2,226	0
75%	2	-	2
100%	9,786	155	9,631
150%	32	0	31
その他	2,430	-	2,430
自己資本控除	-	-	-
合計	48,917	23,106	25,811

5. 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 億円)

区分	エクスポージャーの額
現金	53,327
適格債券	47,660
適格株式	8,927
適格投資信託	-
適格金融資産担保 計	109,914
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	-

6. 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。

(単位 億円)

	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	4,518	5,206	9,724
金利関連取引	18,828	8,175	27,003
株式関連取引	2,629	3,583	6,211
その他取引	2	7	9
クレジット・デリバティブ取引	445	2,368	2,813
合計 (A)	26,421	19,339	45,760
ネットティング契約による与信相当額削減効果 (B)			32,371
ネットの与信相当額 (C=A-B)			13,389
信用リスク削減手法効果勘案 (D)			3,045
現金			1,496
適格債券			1,448
適格株式			101
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)			10,343

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

(単位 億円)

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	14,064	15,779

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。

7. 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

(単位 億円)

主な原資産の種類	エクスポージャーの額	うち自己資本控除扱い
債権	108	0
不動産	1	0
株式	-	-
その他	35	35
合計額	145	35

(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

(単位 億円)

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
20%以下	108	2
20%超50%以下	-	-
50%超100%以下	1	0
100%超350%以下	-	-
350%超1250%以下	-	-
自己資本控除	35	35
合計額	145	37

8. 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 1日 信頼水準 99%

(単位 億円)

	VaRの額
期末値	14
最高値	37
平均値	17
最低値	11

バック・テストング超過回数	1回
---------------	----

(注)バック・テストング

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

9. 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 億円)

	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	1,064	1,064
上記以外の出資等又は株式等エクスポージャー	910	

(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 億円)

	売却益	売却損	償却
出資等又は株式等エクスポージャーの売却及び償却	59	13	21

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 億円)

	評価損益の額
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	45

(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 億円)

	評価損益の額
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	3

(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。

10. 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。

11. 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

トレーディング業務以外の取引から生じる金利リスクの管理に関して金利が 10 ベーシスポイント (0.1%) 変動したものと想定した場合、資産又は負債の時価が合計で 33 億円変動するものと把握しております。

以上