

平成 25 年 11 月 29 日

各 位

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

平成 25 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 25 年 9 月末)について下記のとおりお知らせいたします。

記

自己資本の構成に関する開示事項

(単位 百万円, %)

項目	経過措置に よる不算入額	国際様式の 該当番号
普通株式等Tier1資本に係る基礎項目		
普通株式に係る株主資本の額	911,626	1a+2-1c-26
うち、資本金及び資本剰余金の額	478,099	1a
うち、利益剰余金の額	480,915	2
うち、自己株式の額 ( )	18,475	1c
うち、社外流出予定額 ( )	28,912	26
うち、上記以外に該当するものの額	-	
普通株式に係る新株予約権の額	6,649	1b
その他の包括利益累計額及びその他公表準備金の額	- 70,766	3
普通株式等Tier1資本に係る調整後少数株主持分の額	-	5
経過措置により普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額に算入されるものの額の合計額	71,305	
少数株主持分の額	71,305	
普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額 (イ)	989,582	6
普通株式等Tier1資本に係る調整項目		
無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものを除く。)の額の合計額	- 79,583	8+9
うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	- 12,312	8
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	- 67,270	9
繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	- 2,291	10
繰延ヘッジ損益の額	- 9	11
適格引当金不足額	-	12
証券化取引に伴い増加した自己資本に相当する額	-	13
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	-	14
前払年金費用の額	-	15
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	- 83	16
意図的に保有している他の金融機関等の普通株式の額	-	17
少数出資金融機関等の普通株式の額	- 24,896	18
特定項目に係る十パーセント基準超過額	-	19+20+21
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	-	19
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	-	20
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	-	21
特定項目に係る十五パーセント基準超過額	-	22
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	-	23
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	-	24
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	-	25
その他Tier1資本不足額	1,686	27
普通株式等Tier1資本に係る調整項目の額 (ロ)	1,686	28
普通株式等Tier1資本		
普通株式等Tier1資本の額 ((イ) - (ロ)) (ハ)	987,895	29

(単位 百万円, %)

項目	経過措置に よる不算入額	国際様式の 該当番号
その他Tier1資本に係る基礎項目		
その他Tier1資本調達手段に係る株主資本の額	-	31a
その他Tier1資本調達手段に係る新株予約権の額	-	31b
その他Tier1資本調達手段に係る負債の額	-	32
特別目的会社等の発行するその他Tier1資本調達手段の額	-	
その他Tier1資本に係る調整後少数株主持分等の額	11,378	34-35
適格旧Tier1資本調達手段の額のうちその他Tier1資本に係る基礎項目の額に含まれる額	-	33+35
うち、最終指定親会社及び最終指定親会社の特別目的会社等の発行する資本調達手段の額	-	33
うち、最終指定親会社の連結子法人等(最終指定親会社の特別目的会社等を除く。)の発行する資本調達手段の額	-	35
経過措置によりその他Tier1資本に係る基礎項目の額に算入されるものの額の合計額	752	
少数株主持分等の額	-	
外国為替換算調整	752	
その他Tier1資本に係る基礎項目の額 (二)	10,626	36
その他Tier1資本に係る調整項目		
自己保有その他Tier1資本調達手段の額	-	37
意図的に保有している他の金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額	-	38
少数出資金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額	-	5,014
その他金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額	-	177
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	12,312	
のれん	12,312	
Tier2資本不足額	-	42
その他Tier1資本に係る調整項目の額 (ホ)	12,312	43
その他Tier1資本		
その他Tier1資本の額 ((二) - (ホ)) (ヘ)	-	44
Tier1資本		
Tier1資本の額 ((ハ) + (ヘ)) (ト)	987,895	45
Tier2資本に係る基礎項目		
Tier2資本調達手段に係る株主資本の額	-	
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	-	46
特別目的会社等の発行するTier2資本調達手段の額	-	
Tier2資本に係る調整後少数株主持分等の額	2,677	48-49
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	-	-
うち、最終指定親会社及び最終指定親会社の特別目的会社等の発行する資本調達手段の額	-	47
うち、最終指定親会社の連結子法人等(最終指定親会社の特別目的会社等を除く。)の発行する資本調達手段の額	-	49
一般貸倒引当金Tier2算入額及び適格引当金Tier2算入額の合計額	-	50
うち、一般貸倒引当金Tier2算入額	-	50a
うち、適格引当金Tier2算入額	-	50b
経過措置によりTier2資本に係る基礎項目の額に算入されるものの額の合計額	50,540	
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	50,540	
Tier2資本に係る基礎項目の額 (チ)	53,217	51

(単位 百万円, %)

項目	経過措置による不算入額	国際様式の該当番号
Tier2資本に係る調整項目		
自己保有Tier2資本調達手段の額	-	52
意図的に保有している他の金融機関等のTier2資本調達手段の額	-	53
少数出資金融機関等のTier2資本調達手段の額	24,106	54
その他金融機関等のTier2資本調達手段の額	-	55
経過措置によりTier2資本に係る調整項目の額に算入されるものの額の合計額	73	
その他金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額	73	
Tier2資本に係る調整項目の額 (リ)	73	57
Tier2資本		
Tier2資本の額 ((チ) - (リ)) (ヌ)	53,143	58
総自己資本		
総自己資本合計 ((ト) + (ヌ)) (ル)	1,041,039	59
リスク・アセット		
経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額の合計額	123,579	
少数出資金融機関等の資本調達手段	54,017	
無形固定資産(のれんを除く。)	67,270	
繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)	2,291	
リスク・アセットの額の合計額 (ヲ)	5,026,783	60
連結自己資本規制比率		
連結普通株式等Tier1比率 ((ハ) / (ヲ))	19.6%	61
連結Tier1比率 ((ト) / (ヲ))	19.6%	62
連結総自己資本規制比率 ((ル) / (ヲ))	20.7%	63
調整項目に係る参考事項		
少数出資金融機関等の対象資本調達手段に係る調整項目不算入額	90,709	72
その他金融機関等に係る対象資本調達手段のうち普通株式に係る調整項目不算入額	45,352	73
無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライセンスに係るものに限る。)に係る調整項目不算入額	-	74
繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に係る調整項目不算入額	8,059	75
Tier2資本に係る基礎項目の額に算入される引当金に関する事項		
一般貸倒引当金の額	-	76
一般貸倒引当金に係るTier2資本算入上限額	-	77
内部格付手法採用最終指定親会社において、適格引当金の合計額から事業法人等向けエクスポージャー及びリテール向けエクスポージャーの期待損失額の合計額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-	78
適格引当金に係るTier2資本算入上限額	-	79
資本調達手段に係る経過措置に関する事項		
適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額	-	82
適格旧Tier1資本調達手段の額から適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-	83
適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額	-	84
適格旧Tier2資本調達手段の額から適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-	85

連結の範囲に関する事項

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

相違点はありません。

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

連結子会社の数

53 社

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

	会計上の 連結貸借対照表	告示第3条の規定に基づく 連結貸借対照表	自己資本の構成に 関する開示の参照番号
<b>流動資産</b>			
現金・預金	1,419,255	1,419,255	
預託金	289,744	289,744	
受取手形及び売掛金	13,140	13,140	
有価証券	2,334,809	2,334,809	18, 39, 54, 72, 73
トレーディング商品	7,891,373	7,891,373	16, 18, 39, 54, 72, 73
営業投資有価証券	135,635	135,635	18, 39, 54, 72, 73
投資損失引当金	35,865	35,865	
営業貸付金	196,291	196,291	
仕掛品	967	967	
信用取引資産	227,315	227,315	
有価証券担保貸付金	5,076,814	5,076,814	
立替金	26,477	26,477	
短期貸付金	1,394	1,394	
未収収益	33,819	33,819	
繰延税金資産	5,970	5,970	10, 75
その他の流動資産	280,931	280,931	
貸倒引当金	350	350	
流動資産計	17,897,722	17,897,722	
<b>固定資産</b>			
有形固定資産	426,825	426,825	
無形固定資産	79,583	79,583	
のれん	12,312	12,312	8
のれん以外	67,270	67,270	9
投資その他の資産	249,773	249,773	
投資有価証券	206,575	206,575	18, 39, 54, 72, 73
繰延税金資産	4,380	4,380	10, 75
上記以外	38,818	38,818	
固定資産計	756,182	756,182	
資産合計	18,653,905	18,653,905	

(単位 百万円)

	会計上の 連結貸借対照表	告示第3条の規定に基づく 連結貸借対照表	自己資本の構成に関 する開示の参照番号
<b>負債の部</b>			
<b>流動負債</b>			
支払手形及び買掛金	3,893	3,893	
トレーディング商品	4,988,172	4,988,172	
約定見返勘定	76,097	76,097	
信用取引負債	52,936	52,936	
有価証券担保借入金	6,275,147	6,275,147	
銀行業における預金	2,092,620	2,092,620	
預り金	224,411	224,411	
受入保証金	376,895	376,895	
短期借入金	737,013	737,013	
コマーシャルペーパー	268,773	268,773	
1年内償還予定の社債	217,217	217,217	
未払法人税等	10,427	10,427	
繰延税金負債	15,782	15,782	
賞与引当金	29,629	29,629	
その他の流動負債	129,012	129,012	
<b>固定負債</b>			
社債	1,224,919	1,224,919	
長期借入金	670,158	670,158	
繰延税金負債	16,476	16,476	
退職給付引当金	32,807	32,807	
訴訟損失引当金	645	645	
負ののれん	5,707	5,707	
その他の固定負債	17,756	17,756	
特別法上の準備金	2,555	2,555	
負債合計	17,469,058	17,469,058	
<b>純資産の部</b>			
<b>株主資本</b>			
資本金	247,397	247,397	1a
資本剰余金	230,702	230,702	1a
利益剰余金	480,915	480,915	2
自己株式	18,475	18,475	1c
株主資本合計	940,539	940,539	
<b>その他の包括利益累計額</b>			
その他有価証券評価差額金	80,597	80,597	
繰延ヘッジ損益	9,079	9,079	11
為替換算調整勘定	752	752	
その他の包括利益累計額	70,766	70,766	3
新株予約権	6,649	6,649	1b
少数株主持分	166,891	166,891	34-35, 48-49
純資産合計	1,184,846	1,184,846	

## 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25年9月末
資産(オン・バランス)項目	121,919
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	909
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	558
7.国際開発銀行	-
8.地方公共団体金融機構	690
9.我が国の政府関係機関	2,182
10.地方三公社	-
11.金融機関及び第一種金融商品取引業者	11,263
12.法人等	23,466
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	463
16.三月以上延滞等	933
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	22,957
21.上記以外	42,168
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)	1,699
24.ファンド	14,624



(単位 百万円)

	平成25年9月末
オフバランス取引等項目	48,000
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	-
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	215
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	14,275
12.派生商品取引	32,212
13.長期決済期間取引	56
14.未決済取引	1,028
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	211
CVAリスク相当額	54,254
中央清算機関 関連エクスポージャー	2,080
信用リスクに対する所要自己資本の額	226,254

(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25年9月末
標準的方式	55,942
金利リスク	45,596
株式リスク	9,001
外国為替リスク	1,328
コモディティ・リスク	2
オプション取引	-
内部モデル方式	55,438
マーケット・リスクに対する所要自己資本の額	111,381

## 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25年9月末
基礎的手法	64,512
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	64,512

連結総所要自己資本額

(単位 百万円)

	平成25年9月末
信用リスクに対する所要自己資本の額	226,254
マーケット・リスクに対する所要自己資本の額	111,381
オペレーショナル・リスクに対する所要自己資本の額	64,512
連結総所要自己資本の額	402,147

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25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 <sup>( )</sup>	
日本	15,011,239	99,202	5,386,633	4,316,047	2,655,917	2,553,438	7,597
海外	8,527,307	102	8,138,792	99,182	9,438	279,791	383
地域別合計	23,538,546	99,305	13,525,426	4,415,230	2,665,355	2,833,229	7,980
ソブリン	3,561,775	-	644,700	54,373	1,959,639	903,061	1
金融機関	8,400,119	-	4,206,451	3,492,367	44,368	656,932	247
法人	4,071,423	21,254	3,176,493	463,550	258,618	151,506	7,731
個人	301,253	78,050	-	76	-	223,125	-
CCP	5,949,880	-	5,497,780	404,862	-	47,237	-
その他	1,254,094	-	-	-	402,728	851,366	-
業種別合計	23,538,546	99,305	13,525,426	4,415,230	2,665,355	2,833,229	7,980
1年以下	12,839,035	90,585	12,145,505	394,026	13,897	195,021	/
1年超3年以下	302,263	114	-	251,660	50,488	-	
3年超5年以下	659,641	-	-	516,461	143,180	-	
5年超7年以下	2,901,758	-	-	2,880,684	21,074	-	
7年超	1,933,958	232	-	372,203	1,561,522	-	
期間の定めのないもの	4,901,889	8,373	1,379,920	194	875,192	2,638,208	
残存期間別合計	23,538,546	99,305	13,525,426	4,415,230	2,665,355	2,833,229	

( ) 「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25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	36,508	621
	海外	26	1
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	508	67
	個人	-	81
	その他	36,026	472
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25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%	2,664,690	357,910	2,306,779
2%	303,083	-	303,083
10%	237,150	-	237,150
20%	1,924,689	1,898,319	26,370
35%	531	-	531
50%	214,560	214,558	2
75%	-	-	-
100%	1,254,335	37,883	1,216,452
150%	7,750	7,395	354
250%	78,864	-	78,864
1250%	983	-	983
その他	385,287	-	385,287
合計	7,071,927	2,516,067	4,555,860

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25年9月末
現金	7,525,169
適格債券	5,839,802
適格株式	428,092
適格投資信託	-
適格金融資産担保 計	13,793,063
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 25 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	704,819	619,553	1,324,372
金利関連取引	1,218,869	584,564	1,803,434
株式関連取引	493,070	381,955	875,026
その他取引	72	271	344
クレジット・デリバティブ取引	32,764	380,042	412,806
合計 (A)	2,449,597	1,966,387	4,415,984
ネットティング契約による与信相当額削減効果 (B)			2,851,315
ネットの与信相当額 (C=A-B)			1,564,668
信用リスク削減手法効果勘案 (D)			350,977
現金			225,835
適格債券			115,506
適格株式			9,635
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)			1,213,691

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 25 年 9 月末】

(単位 百万円)

クレジット・デリバティブの種類	想定元本額	
	プロテクション購入	プロテクション提供
クレジット・デフォルト・スワップ	2,313,081	2,216,663

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 25 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	118,974	459	-	-
不動産	-	-	-	-
株式	-	-	-	-
その他	-	-	-	-
合計額	118,974	459	-	-

(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 25 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	118,515	-	1,896	-
20%超50%以下	459	459	14	14
50%超100%以下	-	-	-	-
100%超350%以下	-	-	-	-
350%超1250%未満	-	-	-	-
1250%	-	-	-	-
合計額	118,974	459	1,910	14

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

該当ありません。

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

該当ありません。

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

(1) 主な原資産の種類別の内訳

【平成 25 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	1,056	-	-
不動産	-	-	-
株式	-	-	-
その他	-	-	-
合計額	1,056	-	-

(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 25 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	1,056	-	16
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	1,056	-	16

(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 25 年 9 月末】

(単位 百万円)

	VaRの額	ストレスVaRの額
期末値	2,495	8,172
最高値	12,844	19,137
平均値	6,276	12,998
最低値	2,495	6,353

バック・テスト超過回数	5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25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	152,887	152,887
上記以外の出資等又は株式等エクスポージャー	91,533	

(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25年9月末		
売却益	売却損	償却
15,291	294	24

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25年9月末
評価損益の額	71,925

(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25年9月末
評価損益の額	23

(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 25 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 16 億円変動するものと把握しております。

( 2 ) 銀行業務を行う子会社で保有する金融資産及び金融負債

銀行業務を行う子会社では、金融資産及び金融負債について、金利以外の全てのリスク変数が一定であると仮定した場合の金利変動による経済価値は、71 億円減少するものと把握しております。

## 自己資本調達手段に関する契約内容の概要

1	発行者	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無
3	準拠法	国内法
	規制上の取り扱い	
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	普通株式
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額	
	連結自己資本規制比率	911,626百万円
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	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	295百万円	1,190百万円
9	額面総額	-	-
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2006年7月1日	2006年9月4日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2026年6月30日	2016年6月23日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種類	変動	変動
18	配当率又は利率	-	-
19	配当等停止条項の有無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合	-	-
25	転換の範囲	-	-
26	転換の比率	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無	無	無
31	元本の削減が生じる場合	-	-
32	元本の削減が生じる範囲	-	-
33	元本回復特約の有無	-	-
34	その概要	-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	-	-

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2007年7月発行新株予約権	第4回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	320百万円	832百万円
9	額面総額	-	-
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2007年7月1日	2007年9月3日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2027年6月30日	2017年6月22日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種類	変動	変動
18	配当率又は利率	-	-
19	配当等停止条項の有無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合	-	-
25	転換の範囲	-	-
26	転換の比率	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無	無	無
31	元本の削減が生じる場合	-	-
32	元本の削減が生じる範囲	-	-
33	元本回復特約の有無	-	-
34	その概要	-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	-	-

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2008年7月発行新株予約権	第5回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	292百万円	713百万円
9	額面総額	-	-
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2008年7月1日	2008年9月8日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2028年6月30日	2018年6月20日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種類	変動	変動
18	配当率又は利率	-	-
19	配当等停止条項の有無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合	-	-
25	転換の範囲	-	-
26	転換の比率	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無	無	無
31	元本の削減が生じる場合	-	-
32	元本の削減が生じる範囲	-	-
33	元本回復特約の有無	-	-
34	その概要	-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	-	-

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2009年7月発行新株予約権	第6回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	353百万円	564百万円
9	額面総額	-	-
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2009年7月1日	2009年11月9日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2029年6月30日	2019年6月19日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種類	変動	変動
18	配当率又は利率	-	-
19	配当等停止条項の有無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合	-	-
25	転換の範囲	-	-
26	転換の比率	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無	無	無
31	元本の削減が生じる場合	-	-
32	元本の削減が生じる範囲	-	-
33	元本回復特約の有無	-	-
34	その概要	-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	-	-

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2010年7月発行新株予約権	第7回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	382百万円	392百万円
9	額面総額	-	-
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2010年7月1日	2010年9月1日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2030年6月30日	2020年6月25日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種類	変動	変動
18	配当率又は利率	-	-
19	配当等停止条項の有無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合	-	-
25	転換の範囲	-	-
26	転換の比率	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無	無	無
31	元本の削減が生じる場合	-	-
32	元本の削減が生じる範囲	-	-
33	元本回復特約の有無	-	-
34	その概要	-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	-	-



1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2011年7月発行新株予約権	第8回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	431百万円	225百万円
9	額面総額	-	-
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2011年7月1日	2011年9月5日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2031年6月30日	2021年6月24日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種類	変動	変動
18	配当率又は利率	-	-
19	配当等停止条項の有無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合	-	-
25	転換の範囲	-	-
26	転換の比率	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無	無	無
31	元本の削減が生じる場合	-	-
32	元本の削減が生じる範囲	-	-
33	元本回復特約の有無	-	-
34	その概要	-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	-	-

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2013年2月発行新株予約権	第9回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	472百万円	184百万円
9	額面総額	-	-
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2013年2月12日	2013年2月12日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2032年6月30日	2022年6月26日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種類	変動	変動
18	配当率又は利率	-	-
19	配当等停止条項の有無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合	-	-
25	転換の範囲	-	-
26	転換の比率	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無	無	無
31	元本の削減が生じる場合	-	-
32	元本の削減が生じる範囲	-	-
33	元本回復特約の有無	-	-
34	その概要	-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	-	-

1	発行者	大和証券オフィス投資法人
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無
3	準拠法	国内法
	規制上の取り扱い	
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額 その他Tier1資本に係る基礎項目の額、 Tier2資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	その他Tier1資本に係る基礎項目の額、 Tier2資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	投資口
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額	
	連結自己資本規制比率	85,361百万円
9	額面総額	-
10	表示される科目の区分	
	連結貸借対照表	少数株主持分
11	発行日	-
12	償還期限の有無	無
13	その日付	-
14	償還等を可能とする特約の有無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	-
	剰余金の配当又は利息の支払	
17	配当率又は利率の種類	変動
18	配当率又は利率	-
19	配当等停止条項の有無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無
24	転換が生じる場合	-
25	転換の範囲	-
26	転換の比率	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-
30	元本の削減に係る特約の有無	無
31	元本の削減が生じる場合	-
32	元本の削減が生じる範囲	-
33	元本回復特約の有無	-
34	その概要	-
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無
37	非充足資本要件の内容	-

以上