

平成 25 年 5 月 31 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 25 年 3 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 3 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	847,123	1a+2-1c-26
うち、資本金及び資本剰余金の額	478,073	1a
うち、利益剰余金の額	408,647	2
うち、自己株式の額 ( )	19,212	1c
うち、社外流出予定額 ( )	20,385	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	6,387	1b
その他の包括利益累計額及びその他公表準備金の額	-	44,264
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	71,595	
少数株主持分の額	71,595	
普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額 (イ)	925,106	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	-	84,439
うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	-	15,465
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	-	68,974
繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	-	3,369
繰延ヘッジ損益の額	-	20
適格引当金不足額	-	-
証券化取引に伴い増加した自己資本に相当する額	-	-
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	-	-
前払年金費用の額	-	-
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	-	893
意図的に保有している他の金融機関等の普通株式の額	-	-
少数出資金融機関等の普通株式の額	-	29,335
特定項目に係る十パーセント基準超過額	-	-
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	-	-
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	-	-
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	-	-
特定項目に係る十五パーセント基準超過額	-	-
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	-	-
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	-	-
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	-	-
その他Tier1資本不足額	20,336	27
普通株式等Tier1資本に係る調整項目の額 (ロ)	20,336	28
普通株式等Tier1資本		
普通株式等Tier1資本の額 ((イ) - (ロ)) (ハ)	904,770	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	10,838	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	15,709	
少数株主持分等の額	-	
外国為替換算調整	15,709	
その他Tier1資本に係る基礎項目の額 (二)	4,871	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	-	2,380
その他金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額	-	73
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	15,465	
のれん	15,465	
Tier2資本不足額	-	42
その他Tier1資本に係る調整項目の額 (ホ)	15,465	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 ((八) + (ヘ)) (ト)	904,770	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	2,550	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	-	47+49
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	45,803	
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	45,803	
Tier2資本に係る基礎項目の額 (チ)	48,353	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	26,268	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)	48,279	58
総自己資本		
総自己資本合計 ((ト) + (ヌ)) (ル)	953,050	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	130,328	
少数出資金融機関等の資本調達手段	57,984	
無形固定資産 (のれんを除く。)	68,974	
繰延税金資産 (一時差異に係るものを除く。)	3,369	
リスク・アセットの額の合計額 (ヲ)	4,755,172	60
連結自己資本規制比率		
連結普通株式等Tier1比率 ((ハ) / (ヲ))	19.0%	61
連結Tier1比率 ((ト) / (ヲ))	19.0%	62
連結総自己資本規制比率 ((ル) / (ヲ))	20.0%	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	80,909	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	45,186	73
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	-	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	5,302	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

## 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

52 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
大和証券エスエムピ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。

## 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、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を確保した上で配賦原資を設定し、その範囲内で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量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、当該リスク量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。

## 3. 信用リスクに関する事項

### イ リスク管理の方針及び手続きの概要

(信用リスク管理の基本方針)

信用リスクが生じる取引については、事前に取引先の格付等に基づく与信枠を設定し、想定元本や与信相当額をモニタリングしております。相対的にエクスポージャーが大きいホールセールビジネスについては、特に、個々の取引先毎に信用水準をモデル評価し、期間、担保の有無、諸契約の有効性といった与信回収の確実性を踏まえて与信枠を設定しています。さらに、クレジットポートフォリオの適切性については信用 VaR を計測し、いずれもリスク総量の妥当性について定期的な検証を実施しております。

(貸倒引当金)

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。

(信用リスク・アセットの算出)

信用リスク・アセットの算出にあたっては、「標準的手法」を採用しております。

### ロ リスクウェイトの判定に使用する格付機関等の名称

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

スタンダード・アンド・プアーズ・レーティングズ・サービスズ

#### 4. 信用リスク削減手法に関するリスク管理の方針及び手続きの概要

(信用リスク削減手法の基本方針)

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。担保は毎日時価評価し、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。

また、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。

#### 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リスク管理の方針及び手続きの概要

派生商品取引においては、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り、与信枠が付与されます。取引が継続している間は、毎日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。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、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。

リスク資本は、信用 VaR の値を基準に配賦され、原則として半年毎に見直しが行われています。

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性が生じますが、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。

#### 6. 証券化エクスポージャーに関する事項

##### イ リスク管理の方針及びリスク特性の概要

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。

当該証券化商品については、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 号までに規程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 信用リスク削減手法として証券化取引を用いる場合の方針

該当ありません。

- ニ 信用リスク・アセットの額の算出に使用する方式の名称  
標準的手法を採用しております。
- ホ マーケット・リスク相当額の算出に使用する方式の名称  
一般市場リスクについては内部モデル方式、個別リスクについては標準的方式を採用しております。
- ヘ 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種類及び当該証券化エクスポージャーを保有しているかどうかの別  
証券化目的導管体の種類は信託や特定目的会社を用いており、期末において当該証券化エクスポージャーの一部を保有しており、オンバランス取引として扱っております。
- ト 会社グループの子会社等（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（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ているものの名称  
該当ありません。
- チ 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。
- リ 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  
スタンダード・アンド・プアーズ・レーティングズ・サービスズ  
フィッチレーティングスリミテッド
- ヌ 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。
- ル 定量的な情報に重要な変更が生じた場合には、その内容  
該当ありません。



## 7. マーケット・リスクに関する事項

### イ リスク管理の方針及び手続きの概要

当社グループのトレーディング・ポジションでは、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）、ポジション、感応度などに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。

VaR 計測モデルの有効性を検証するため、算出した VaR と損益を比較するバック・テストを実施しております。また、一定期間のデータに基づいて統計的仮定により算出した VaR の限界を補うべく、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、ストレステストを実施しております。

### ロ マーケット・リスク相当額の算出に使用する方式の名称

#### (1) 内部モデル方式

大和証券株式会社、海外証券子会社の一般市場リスク

#### (2) 標準的方式

- ・ 個別リスク
- ・ (1) に記載の会社以外の一般市場リスク

### ハ 想定される保有期間及び保有期間が想定を超える蓋然性等を踏まえ、取引の特性に応じて適切に価格を評価するための方法

時価算出に関する規程やマニュアルを定め、トレーディングを行う部署から独立した部署が、評価価格及び算出方法の妥当性について検証を行っております。これらについては定期的に外部監査を受けております。

### ニ 内部モデル方式のモデルの概要並びにバック・テスト及びストレステストの説明

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 を内部モデル方式で使用しております。また、算出された VaR と損益を比較するバック・テストを実施し、VaR 計測モデルの有効性を検証しております。マーケットの急激な変動が生じた場合に予想される損失額を把握するため、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、ストレステストを実施しています。

### ホ 追加的リスクを内部モデルで計測している場合、当該モデルの概要

該当ありません。

### ヘ 包括的リスクを内部モデルで計測している場合、当該モデルの概要

該当ありません。

ト マーケット・リスクに対する自己資本の充実度を内部的に評価する際に用いている各種の前提及び評価の方法

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(以下、「HS法」)を採用しております。HS法を評価する際の前提は以下のとおりです。

- ・保有期間：10 営業日
- ・観測期間：520 営業日
- ・信頼水準：99%

8. 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。

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リスク管理の方針及び手続の概要

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あるいは信用リスク管理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。

また評価方法は、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)、時価のない株式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。

## 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する次に掲げる事項

### 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については、主に大和ネクスト銀行が保有する資産・負債から金利リスクが生じます。

大和ネクスト銀行は、市場リスクに関する管理諸規程に従い、金利等の市場のリスク・ファクターの変動により、資産・負債（オフバランスを含む）の価値または資産・負債から生み出される収益が変動し損失を被るリスクを管理しています。

フロントオフィスから独立したミドルオフィス及びバックオフィスを設置し、相互に牽制が働く体制としております。また、定期的開催されるALM委員会にて、市場・流動性リスクの管理・運営及び資産・負債・資本運営に関する重要事項を審議しております。

### ロ 内部管理上使用したトレーディング業務以外の取引から生じる金利リスク算定手法の概要

#### （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）

金利リスクの影響を受ける主たる金融資産・金融負債は「社債」及び「長期借入金」であり、金利が10ベース・ポイント（0.1%）変動したものと想定した場合の時価の変動額を算出しております

#### （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、保有期間1年、過去5年の観測期間で計測される金利変動の99パーセンタイル値を用いた経済価値の変動額を市場リスク量とし、金利の変動リスクの管理にあたっての定量的分析に利用しております。

当該変動額の算定にあたっては、対象の金融資産及び金融負債をそれぞれ金利期日に応じて適切な期間に残高を分解し、期間ごとの金利変動幅を用いております。なお、全体の資産ないし負債の5%に満たない通貨については、一律上下200ベース・ポイント（2%）の平行移動による金利ショックを採用し当該変動額を算定しております。

11. 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	1,212,243	1,212,243	
預託金	260,197	260,197	
受取手形及び売掛金	13,675	13,675	
有価証券	2,113,038	2,113,038	18, 39, 54, 72, 73
トレーディング商品	8,849,128	8,849,128	16, 18, 39, 54, 72, 73
約定見返勘定	235,449	235,449	
営業投資有価証券	149,329	149,329	18, 39, 54, 72, 73
投資損失引当金	35,495	35,495	
営業貸付金	171,843	171,843	
仕掛品	574	574	
信用取引資産	193,642	193,642	
有価証券担保貸付金	4,841,726	4,841,726	
立替金	26,934	26,934	
短期貸付金	10,524	10,524	
未収収益	34,831	34,831	
繰延税金資産	5,643	5,643	10, 75
その他の流動資産	246,143	246,143	
貸倒引当金	280	280	
流動資産計	18,329,152	18,329,152	
<b>固定資産</b>			
有形固定資産	407,118	407,118	
無形固定資産	84,439	84,439	
のれん	15,465	15,465	8
のれん以外	68,974	68,974	9
投資その他の資産	228,389	228,389	
投資有価証券	192,906	192,906	18, 39, 54, 72, 73
繰延税金資産	3,028	3,028	10, 75
上記以外	32,454	32,454	
固定資産計	719,947	719,947	
資産合計	19,049,099	19,049,099	

(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	自己資本の構成に關 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	3,508	3,508	
トレーディング商品	4,965,693	4,965,693	
信用取引負債	57,762	57,762	
有価証券担保借入金	7,142,965	7,142,965	
銀行業における預金	1,791,765	1,791,765	
預り金	168,453	168,453	
受入保証金	286,675	286,675	
短期借入金	946,311	946,311	
コマーシャルペーパー	301,711	301,711	
1年内償還予定の社債	221,291	221,291	
未払法人税等	3,094	3,094	
繰延税金負債	13,889	13,889	
賞与引当金	30,855	30,855	
その他の流動負債	121,448	121,448	
<b>固定負債</b>			
社債	1,198,172	1,198,172	
長期借入金	642,835	642,835	
繰延税金負債	10,403	10,403	
退職給付引当金	31,813	31,813	
訴訟損失引当金	648	648	
負ののれん	7,990	7,990	
その他の固定負債	16,685	16,685	
特別法上の準備金	2,555	2,555	
負債合計	17,966,531	17,966,531	
<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	230,676	230,676	1a
利益剰余金	408,647	408,647	2
自己株式	19,212	19,212	1c
株主資本合計	867,509	867,509	
<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	76,740	76,740	
繰延ヘッジ損益	16,765	16,765	11
為替換算調整勘定	15,709	15,709	
その他の包括利益累計額	44,264	44,264	3
新株予約権	6,387	6,387	1b
少数株主持分	164,406	164,406	34-35, 48-49
純資産合計	1,082,567	1,082,567	

## 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3月末
資産(オン・バランス)項目	117,339
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	1,133
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	439
7.国際開発銀行	-
8.地方公共団体金融機構	477
9.我が国の政府関係機関	1,567
10.地方三公社	-
11.金融機関及び第一種金融商品取引業者	10,305
12.法人等	24,202
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	527
16.三月以上延滞等	84
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	23,418
21.上記以外	40,292
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)	1,461
24.ファンド	13,427

(単位 百万円)

	平成25年3月末
オフバランス取引等項目	46,881
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	210
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	14,118
12.派生商品取引	31,734
13.長期決済期間取引	448
14.未決済取引	291
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	79
CVAリスク相当額	54,194
中央清算機関 関連エクスポージャー	1,791
信用リスクに対する所要自己資本の額	220,206

(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3月末
標準的方式	60,844
金利リスク	49,369
株式リスク	7,864
外国為替リスク	3,610
コモディティ・リスク	2
オプション取引	-
内部モデル方式	41,208
マーケット・リスクに対する所要自己資本の額	102,060

## 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3月末
基礎的手法	58,147
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	58,147

連結総所要自己資本額

(単位 百万円)

	平成25年3月末
信用リスクに対する所要自己資本の額	220,206
マーケット・リスクに対する所要自己資本の額	102,060
オペレーショナル・リスクに対する所要自己資本の額	58,147
連結総所要自己資本の額	380,413



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3月末】

(単位 百万円)

		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	レポ	デリバティブ	有価証券	その他 <sup>( )</sup>		
地域別	日本	15,394,042	100,914	6,064,087	4,595,318	2,440,165	2,193,556	1,154
	海外	7,759,709	118	7,394,467	108,322	15,734	241,066	370
地域別合計		23,153,752	101,032	13,458,555	4,703,641	2,455,899	2,434,623	1,524
業種別	ソブリン	3,153,149	-	628,369	58,071	1,721,796	744,912	0
	金融機関	9,581,598	10,000	5,082,891	3,873,435	47,516	567,755	238
	法人	3,943,645	20,911	2,990,328	471,545	309,948	150,910	1,248
	個人	267,624	70,120	-	85	-	197,419	38
	CCP	5,099,185	-	4,756,965	300,504	-	41,716	-
	その他	1,108,548	-	-	-	376,637	731,910	-
業種別合計		23,153,752	101,032	13,458,555	4,703,641	2,455,899	2,434,623	1,524
残存期間別	1年以下	12,600,173	91,891	11,962,457	296,487	34,347	214,989	/
	1年超3年以下	295,159	135	-	263,735	31,288	-	
	3年超5年以下	1,368,737	2	-	1,207,969	160,765	-	
	5年超7年以下	2,583,269	-	-	2,552,644	30,625	-	
	7年超	1,795,027	264	-	379,520	1,415,243	-	
	期間の定めのないもの	4,511,384	8,738	1,496,097	3,283	783,630	2,219,634	
残存期間別合計		23,153,752	101,032	13,458,555	4,703,641	2,455,899	2,434,623	

( ) 「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3月末	期中増減額
一般貸倒引当金	/	-	200
個別貸倒引当金	日本	37,128	70
	海外	24	3
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	/	-	200
個別貸倒引当金	ソブリン	-	-
	金融機関	-	-
	法人	575	383
	個人	80	77
	その他	36,497	239
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3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%	2,324,459	207,013	2,117,446
2%	171,325	-	171,325
10%	198,388	-	198,388
20%	1,903,790	1,868,021	35,769
35%	26	-	26
50%	252,455	249,539	2,916
75%	-	-	-
100%	1,151,872	52,784	1,099,088
150%	1,247	348	899
250%	70,611	-	70,611
その他	321,463	-	321,463
1250%	3,012	-	3,012
合計	6,398,653	2,377,706	4,020,947

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3月末
現金	7,925,786
適格債券	5,282,040
適格株式	457,450
適格投資信託	-
適格金融資産担保 計	13,665,277
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 3 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	645,985	645,999	1,291,984
金利関連取引	1,634,680	631,379	2,266,060
株式関連取引	359,285	381,058	740,343
その他取引	75	234	309
クレジット・デリバティブ取引	33,829	376,811	410,641
合計 (A)	2,673,856	2,035,483	4,709,340
ネットティング契約による与信相当額削減効果 (B)			3,151,489
ネットの与信相当額 (C=A-B)			1,557,851
信用リスク削減手法効果勘案 (D)			344,622
現金			182,221
適格債券			154,551
適格株式			7,849
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)			1,213,225

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 3 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	2,284,163	2,218,617

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 3 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	94,598	1,678	-	-
不動産	-	-	-	-
株式	-	-	-	-
その他	-	-	-	-
合計額	94,598	1,678	-	-

(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 3 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	92,919	-	1,486	-
20%超50%以下	1,678	1,678	53	53
50%超100%以下	-	-	-	-
100%超350%以下	-	-	-	-
350%超1250%未満	-	-	-	-
1250%	-	-	-	-
合計額	94,598	1,678	1,540	53

(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 3 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	1,252	-	-
不動産	-	-	-
株式	-	-	-
その他	-	-	-
合計額	1,252	-	-

(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 3 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	1,252	-	20
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	1,252	-	20

(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 3 月末】

(単位 百万円)

	VaRの額	ストレスVaRの額
期末値	5,067	11,937
最高値	6,494	13,065
平均値	3,713	7,664
最低値	2,451	3,890

バック・テスト超過回数	1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3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	135,411	135,411
上記以外の出資等又は株式等エクスポージャー	85,730	

(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3月末		
売却益	売却損	償却
12,726	1,317	776

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3月末
評価損益の額	51,869

(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3月末
評価損益の額	188

(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 3 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 11 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、35 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	847,123百万円
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	305百万円	1,200百万円
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	330百万円	838百万円
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	299百万円	720百万円
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	360百万円	492百万円
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	389百万円	328百万円
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	433百万円	171百万円
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	46百万円
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	84,984百万円
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