2024年 7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　代表執行役社長　荻野　明彦
（コード番号　8601　東証プライム・名証プレミア）

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（2024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（2024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 9
4. 信用リスクに関する事項 14
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） 15
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） 16
7. 証券化取引に係るリスクに関する事項 16
8. マーケット・リスクに関する事項 17
9. オペレーショナル・リスクに関する事項 19
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 19
11. 金利リスクに関する事項 20
12. 連結貸借対照表の科目と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係 21
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 23
■ 定量的な開示事項 24
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 24
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 24
3. リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーについて、エクスポージャーの区分ごとの額 26
4. その他定量的な開示事項 27
■ 連結レバレッジ比率に関する開示事項 50
1. 連結レバレッジ比率の構成に関する開示 50
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 50
■ 自己資本調達手段に関する契約内容の概要 51

■ 主要な指標

【KM1】主要な指標

（単位 百万円、%）

国際様式の該当番号		2024年3月末	2023年12月末	2023年9月末	2023年6月末	2023年3月末
資本						
1	普通株式等Tier1資本の額	1,331,138	1,299,914	1,308,028	1,305,377	1,240,674
2	Tier1資本の額	1,520,820	1,489,647	1,495,881	1,491,860	1,429,860
3	総自己資本の額	1,529,866	1,498,996	1,502,097	1,495,580	1,439,174
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	7,087,470	6,691,815	6,789,921	6,931,589	6,808,704
自己資本比率						
5	連結普通株式等Tier1比率	18.78%	19.42%	19.26%	18.83%	18.22%
6	連結Tier1比率	21.45%	22.26%	22.03%	21.52%	21.00%
7	連結総自己資本比率	21.58%	22.40%	22.12%	21.57%	21.13%
資本バッファー						
8	資本保全バッファー比率	2.50%	2.50%	2.50%	2.50%	2.50%
9	カウンター・シクリカル・バッファー比率	0.08%	0.08%	0.08%	0.05%	0.04%
10	G-SIB/D-SIBバッファー比率	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%
11	最低連結資本バッファー比率	3.08%	3.08%	3.08%	3.05%	3.04%
12	連結資本バッファー比率	13.58%	14.40%	14.12%	13.57%	13.13%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	24,461,756	24,439,442	27,268,928	26,077,120	22,195,226
14	連結レバレッジ比率	6.21%	6.09%	5.48%	5.72%	6.44%

■ 自己資本の構成に関する開示事項

【CC1】自己資本の構成

（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	別紙様式第八号(CC2)の参照項目
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	1,283,131	
1a	うち、資本金及び資本剰余金の額	479,858	(i),(j)
2	うち、利益剰余金の額	961,375	(k)
1c	うち、自己株式の額（△）	123,070	(l),(m)
26	うち、社外流出予定額(△)	35,032	
	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	6,956	(p)
3	その他の包括利益累計額及びその他公表準備金の額	204,112	(o)
5	普通株式等Tier1資本に係る調整後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)	1,494,200	
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	160,132	
8	うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	49,170	(e),(g)
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	110,962	(f)
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	187	(d),(h)
11	繰延ヘッジ損益の額	1,019	(n)
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	593	
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	134	(b)
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	993	(a),(b),(c),(g)
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等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等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	－	
28	普通株式等Tier1資本に係る調整項目の額 (ロ)	163,062	
普通株式等Tier1資本			
29	普通株式等Tier1資本の額 ((イ)－(ロ)) (ハ)	1,331,138	

（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	別紙様式第八号(CC2)の参照項目
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	149,900	
		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	39,897	(q)
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	－	
36		その他Tier1資本に係る基礎項目の額　(ニ)	189,797	
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	115	(a),(b),(c),(g)
40		その他金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額	－	
42		Tier2資本不足額	－	
43		その他Tier1資本に係る調整項目の額　(ホ)	115	
その他Tier1資本				
44		その他Tier1資本の額（(ニ)－(ホ)）　(ヘ)	189,681	
Tier1資本				
45		Tier1資本の額（(ハ)＋(ヘ)）　(ト)	1,520,820	
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	9,387	(q)
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	－	
51		Tier2資本に係る基礎項目の額　(チ)	9,387	

（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	別紙様式第八号(CC2)の参照項目
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資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額	－	
54	少数出資金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額	341	(a),(b),(c),(g)
54a	少数出資金融機関等のその他外部TLAC 関連調達手段のうち、マーケット・メイク目的保有TLACに該当しなくなったものの額	－	
55	その他金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC 関連調達手段の額	－	
57	Tier2資本に係る調整項目の額　(リ)	341	
Tier2資本			
58	Tier2資本の額 ((チ) － (リ))　(ヌ)	9,046	
総自己資本			
59	総自己資本の額 ((ト)＋(ヌ))　(ル)	1,529,866	
リスク・アセット　(5)			
60	リスク・アセットの額の合計額　(ヲ)	7,087,470	
連結自己資本規制比率			
61	連結普通株式等Tier1比率 ((ハ) / (ヲ))	18.78%	
62	連結Tier1比率 ((ト) / (ヲ))	21.45%	
63	連結総自己資本規制比率 ((ル) / (ヲ))	21.58%	
64	最低連結資本バッファー比率	3.08%	
65	うち、資本保全バッファー比率	2.50%	
66	うち、カウンター・シクリカル・バッファー比率	0.08%	
67	うち、G-SIB/D-SIB バッファー比率	0.50%	
68	連結資本バッファー比率	13.58%	
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等調達手段に係る調整項目不算入額	133,213	(a),(b),(c),(g)
73	その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に係る調整項目不算入額	97,100	(a),(b),(c),(g)
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	6,640	(d),(h)
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

会社グループに属する会社は、会計連結範囲に含まれる会社に加え、銀行法施行規則に規定される業務を営む会社を含めているため、会計連結範囲に含まれる会社よりも連結の範囲は広範となっています。

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　144 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
株式会社大和総研	情報サービス業
株式会社大和証券ビジネスセンター	事務代行業
大和証券ファシリティーズ株式会社	不動産賃貸業・管理業
株式会社大和ネクスト銀行	銀行業
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
大和エナジー・インフラ株式会社	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
大和証券リアルティ株式会社	不動産関連業
大和証券オフィス投資法人	特定資産に対する投資運用
サムティ・レジデンシャル投資法人	特定資産に対する投資運用
大和証券キャピタル・マーケッツ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・マーケッツ香港リミテッド	有価証券関連業
大和証券キャピタル・マーケッツ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・マーケッツ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・マーケッツアメリカ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

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は、以下のとおりです。

（単位　百万円）

会社グループに属する会社の名称	主要な業務の内容	総資産の額	純資産の額
大和インベスター・リレーションズ株式会社	企業のIR（投資家向け広報）活動に関するコンサルティング等の支援業務	764	428
DMS Ltd.	システムソリューション、リサーチ、コンサルティング	182	173
Asian Energy Investments Pte., Ltd.	投資運用業、投資助言・代理業	2	0
大和ACAヘルスケア株式会社	投資ファンドの運営、アセットマネジメント、不動産関連事業	364	349
Daiwa Corporate Investment Asia Ltd.	投資業	224	189
アイ・エル・シー株式会社	投資運用業、投資助言・代理業	279	▲ 461
Daiwa Asset Management (H.K.) Limited	投資運用業、投資助言・代理業	63	63

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については、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、規制資本及びストレス・テスト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おります。

＜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、グループ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おります。

＜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をしております。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おります。

また、経営上保有する各種リスクについて、その特性に応じて適切に管理するための基本的事項を定め、財務の健全性及び業務の適切性を確保する体制を構築しております。

＜リスクアペタイト・フレームワーク＞

リスクアペタイト・フレームワークとは、収益目標や事業計画達成のために進んで受け入れるリスクの種類と総量（リスクアペタイト）を明確にし、当社グループ全体のリスクをコントロールする枠組みです。

当社グループでは以下の通りリスクアペタイト・フレームワークを規定し、適切な運営を行っております。

（リスクアペタイト・フレームワークの概要）

当社グループが展開する事業の想定やリスク特性に鑑みて、流動性、自己資本、集中リスク、オペレーショナル・リスク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や超過時の対応を規定の上、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。

リスクアペタイト・フレームワークにおける役割・責任は以下の通りです。

取締役会

当社グループのリスクアペタイトの定量指標を含め、リスクアペタイト・ステートメントを審議・決定します。

監査委員会

リスクアペタイト・フレームワークに関する取締役会及び経営の職務執行の監査を行います。

グループリスクマネジメント会議

取締役会により承認されたリスクアペタイトを踏まえ、リスクリミット（各種限度額等）を設定します。また、グループ各社のリスク管理態勢及びリスクリミットの抵触状況を含むリスクの状況を適切に把握すること等を通じて、当社グループのリスクアペタイトの枠組みが実効的に機能しているかどうかを監視します。

CEO

当社グループ全体のビジネス戦略、リスク戦略及びリスクアペタイト・フレームワークの策定、見直しを含めたグループ経営全般を統括します。

COO

CEO を補佐し、リスクアペタイト・フレームワークを踏まえたグループ経営全般を統括します。

CFO

当社グループのリスクアペタイト・フレームワークのうち、財務に係る業務全般を統括します。

CRO

リスクアペタイト・ステートメントを策定し、同ステートメントについて取締役会の承認を得ます。また、同ステートメントを踏まえ、グループ各社のリスク管理態勢を整備させ、各社のリスク管理部署が行うリスク管理全般を監視することを含め、グループのリスク管理に係る業務全般を統括します。

CDO

当社グループのリスクアペタイト・フレームワークのうち、データガバナンス及び経営情報システムの構築・運営に係る業務全般を統括します。

各社のリスクマネジメント部門、コンプライアンス部門等

リスクアペタイトを踏まえ、業務規模や特性に応じたリスクリミットを整備し、第２の防衛線として全社的なリスク管理を行います。

各社のビジネスを遂行する部門等

設定されたリスクリミットを踏まえてビジネスを執行するとともに、超過した際にリスク管理部署に超過解消施策を含めた必要な報告が行われるよう適切な態勢を整備し、第１の防衛線として、自律的リスク管理を行います。

内部監査部門

当社グループのリスクアペタイト・フレームワークが実効的に機能しているかを検証するため、適切な内部監査態勢を整備し、第３の防衛線として、独立した立場でリスク管理の枠組みを検証・評価します。

（リスクアペタイト・フレームワークの運営体制）

当社グループでは、取締役会において年二回リスクアペタイト・ステートメントの見直しを行っています。

ビジネス戦略や資本配賦計画等が見直される場合、又は外部環境の著しい変化やリスクプロファイルが当初想定していた水準を大きく上回る可能性が生じた場合には、必要に応じて見直しを行なっております。

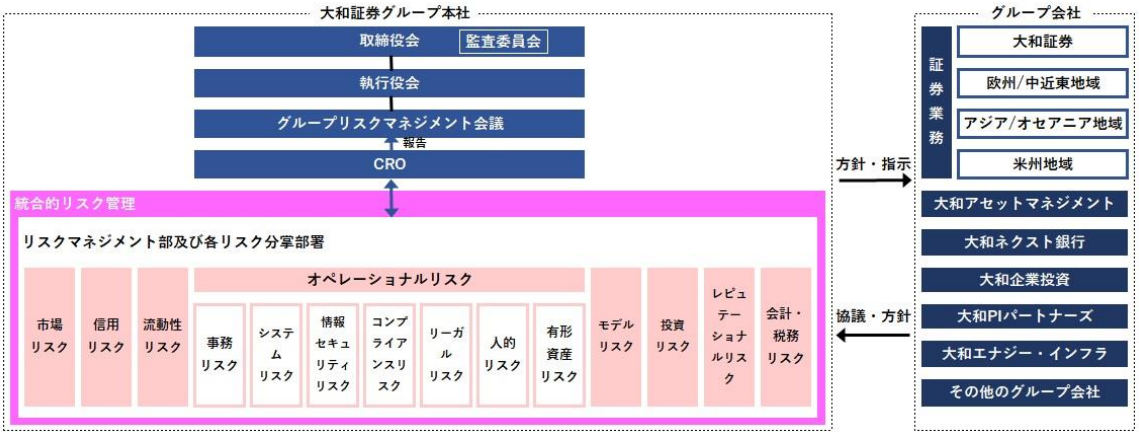
＜リスクの特性及び管理方針、リスク管理態勢＞

当社グループは、経営上、さまざまなリスクに晒されております。当社グループにとって特に重要なリスクは、中核である証券業務に伴うリスクです。当社グループは、自己勘定を活用して一時的に販売目的の商品ポジションを保有し、お客様への商品提供を行うため、外貨を含めた流動性リスク、相場変動に起因する市場リスク、取引先や発行体に対する信用リスク、ヘッジが機能しないリスクのほか、業務を執行する上で必然的に発生するオペレーショナル・リスクや意思決定にモデルを活用することによるモデルリスク等が生じます。また、成長投資を実行することに伴い、投資先の業績や信用状態の悪化、市場環境の変化等に起因する投資リスクも発生します。そのため、フォワードルッキ

ングな視点でグループ内における資本や流動性に与える影響を計測する統合リスク管理を行なっています。

これらのリスクを統合的に管理するため、リスクアペタイト・フレームワークの下、当社グループが中心となり、リスクガバナンス態勢を整備しております。その際、当社グループの執行役会の分科会であるグループリスクマネジメント会議が子会社のリスク管理態勢やリスクの状況をモニタリングし、グループ全体のリスク管理の強化を図ることとしております。

グループリスクマネジメント会議の内容については、開催の都度、監査委員会へ報告を行っております。



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、取締役会の承認のもと、リスク管理の基本方針を「リスク管理規程」に定め、次の通り基本方針を明らかにしております。

（リスク管理の基本方針）

（1） リスク管理への経営の積極的な関与

（2） 当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、リスクを以下のように定義し、各リスクを管理する執行役及び所管部署を設置の上、リスク管理態勢を敷いています。

（リスクの定義）

（1） 市場リスク

金利、外国為替レート、株価などの市場で取引される商品の価格やレートが変化することによって、保有する金融商品又は金融取引により損失を被るリスク及び市場の流動性の著しい低下により市場における取引が成立せず、又は著しく不利な条件での取引を余儀なくされることにより、損失を被るリスクをいいます。

（2） 信用リスク

金融取引の取引先や保有する金融商品の発行体のデフォルト、或いは信用力の変化によって損失を被るリスクをいいます。

（3） 流動性リスク

市場環境の変化、当社グループ及び関係会社の財務内容の悪化等により資金繰りに支障をきたす、或いは通常よりも著しく高い資金調達コストを余儀なくされるリスクをいいます。

（4） オペレーショナル・リスク

内部プロセス・人・システムが不適切であることもしくは機能しないこと、又は外生的事象が生起することから生じる損失に係るリスクをいいます。

（5） モデルリスク

モデルの開発、実装における誤り、又はモデルの誤用に起因して、当社グループが損失を被るリスクをいいます。

（6） 投資リスク

投資先の業績や信用状態の悪化、市場環境の変化等により、当社グループが行う投資の価値が毀損する、或いは追加の資金拠出が必要となるリスクや、投資から得られる収益が期待を下回るリスクをいいます。

（7） レピュテーショナル・リスク

会社、役職員の行動が、対外的にネガティブな印象を与えることにより、顧客並びに利益を喪失するリスクをいい、ディスクロージャーに関わるものを含みます。

（8） 会計・税務リスク

会計における基準・法令諸規則等に照らし適正な処理・開示が行われないリスク、税務における基準・法令諸規則等に照らし適正な申告・納付が行われないリスク、又はそれらに伴い損失を被るリスクをいいます。

なお、当社グループでは、各リスクを管理する執行役及び部署、リスク管理に係る方針及び具体的な施策を審議・決定する会議体を、リスクの区分に応じ、以下の通りとしております。

リスク・カテゴリー	執行役	所管部署	会議体
市場リスク	CRO	リスクマネジメント部	グループリスクマネジメント会議
信用リスク	CRO	リスクマネジメント部	グループリスクマネジメント会議
流動性リスク	CRO	リスクマネジメント部	グループリスクマネジメント会議
オペレーショナル・リスク	CRO	リスクマネジメント部	グループリスクマネジメント会議
モデルリスク	CRO	リスクマネジメント部	グループリスクマネジメント会議
投資リスク	CRO	リスクマネジメント部	グループリスクマネジメント会議
レピュテーショナル・リスク	広報担当執行役 IR 室を管轄する執行役 コンプライアンス担当執行役	広報部 IR 室 コンプライアンス統括部	ディスクロージャー委員会
会計・税務リスク	CFO	財務部	グループリスクマネジメント会議

（３つの防衛線）

さらに、当社グループは、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」に基づくリスク管理の枠組みを整備しております。

「３つの防衛線」とは、リスク管理における機能と役割・責任を明確にし、健全な管理を行う考え方であり、「第１の防衛線」は自律的リスク管理、「第２の防衛線」は全社的リスク管理、「第３の防衛線」は内部監査の機能を有しております。

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。

また、当社グループは信用リスクの適切な管理を行う体制となっています。リスク管理部署は、計測した与信相当額等を日次で経営陣に報告するとともに、取引先の審査や与信枠の設定、リスク量の計測、信用リスク状況のモニタリングを行い、グループリスクマネジメント会議への報告等を行っています。

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、キャッシュ・フロー見積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 2022 年４月 14 日）

に規定する正常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。すべての債権は、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

ムーディーズ・インベスターズ・サービス

S&P グローバル・レーティング

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）

イ) ネッティングを利用する方針及びプロセスの基本的な特徴並びにネッティングの利用状況に係る説明

証券担保ローンにおいては、担保として受入れた有価証券の時価の範囲内の借入上限額まで貸付を行っており、貸付後は、貸付額と担保評価額をネッティングするとともに、貸付額の担保評価額に対する比率の悪化に応じて追加担保の差入を依頼しています。それでも改善されない場合には担保処分等により債権の保全を図ります。

ロ) 担保評価・担保管理の方針・プロセスの基本的な特徴

債権保全の手段として主に担保を利用しており、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。それぞれ担保の信用力や流動性を考慮して、適格な担保の種類や評価掛目を設定しております。

また、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。

ハ) 使用する信用リスク削減手法におけるマーケット・リスク又は信用リスクの集中状況に関する説明

担保である有価証券の価格は変動するため、当該変動性を考慮して評価掛目を設定しています。また、各取引先から受入れる同一株式については、受入担保株数に上限等を設定し、集中の防止を図っております。

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）

イ）カウンターパーティ及び中央清算機関に対するエクスポージャーに関するリスク資本及び与信限度枠の割当方法に関する方針

派生商品取引及びレポ形式の取引においては、事前に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。

ロ）担保、保証、ネッティングその他の信用リスク削減手法に関する評価並びに担保等の管理の方針及び処分手続の概要

債権保全の手段として主に担保を利用しており、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。それぞれ担保の信用力や流動性を考慮して、適格な担保の種類や評価掛目を設定しております。

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。取引先が債務不履行等となった場合には、担保を市場で売却し債権保全を図ります。

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、シミュレーションで計算した将来の期待エクスポージャーと市場で観測される CDS スプレッドに基づき引当金を計算しています。

派生商品取引及びレポ取引では、原則として相対ネッティング契約（ISDA マスター契約等）や担保契約（ISDA CSA 契約等）を締結しており、法的な有効性を確認できる相対ネッ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。

ハ）自社の信用力悪化により担保を追加的に提供することが必要となる場合の影響度に関する説明

自社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、問題ない水準です。

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

当社グループは主に投資家として証券化取引に関与しており、投資業務、銀行業務及びトレーディング業務において証券化商品を保有しております。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 226 条第 1 項第 1 号から第 4 号まで（連結自己資本規制比率告示第 280 条の 2 第 2 項において準用する場合を含む。）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、規程に基づき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
S&P グローバル・レーティング

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、市場流動性を提供することで対価を得るとともに、一定の金融資産等の保有を通じてマーケット・リスクを負っています。当社グループでは、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。

また、当社グループでは、トレーディング業務を担当する部門において、自らの市場リスクを把握する目的でポジションや感応度を算出しモニタリングを行っている一方で、リスク管理部署においても、グループ全体の市場リスクの状況をモニタリングし、設定された限度枠内であるかどうかを確認の上、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

当社グループのうち、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。当該内部モデルにおいては、「為替変動リスク」「金利変動リスク」「株価変動リスク」「商品リスク」に関する一般市場リスクを計測しております。

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。

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ビティ法	
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	

(補足説明)

・内部管理に用いる VaR モデルについては、株式に関する個別リスク、クレジットスプレッドリスク等を反映し、より広範囲なマーケット・リスクを捕捉しております。

・2007 年 4 月 2 日以降の連続する 260 営業日について全て VaR を計算し、それが最大値となる 260 日間をストレス期間としております。

・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、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・テストも併せて実施しています。

・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・テスティングを実施し、モデルの有効

性を検証しております。

2024年3月期の直近250営業日においては、信頼水準99%のVaRの超過はありません。

・当社グループの内部モデルは、1年に1回、内部監査部門による内部監査を受けるとともに、定期的にグループ内の第三者による独立検証を受けております。

・追加的リスク、包括的リスクについては該当ありません。

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、当社グループのオペレーショナル・リスク管理に関する規程に基づき、下記の枠組みにより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。

＜オペレーショナル・リスク管理の枠組み＞

当社グループはオペレーショナル・リスク管理の枠組みとして、RCSA（リスク・コントロール・セルフ・アセスメント）を実施しております。RCSAとは、業務の実施者自らがオペレーショナル・リスクの特定・把握・評価を行い、発生頻度、影響度からリスクを分析し、リスク軽減策等の有効性を評価、検証するプロセスです。RCSAはグループの主要な会社で定期的に実施しており、実施結果はグループリスクマネジメント会議で報告されます。

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

イ)リスクを確実に認識し、評価・計測し、報告するための体制

当社グループはトレーディング業務以外にも、投資業務、銀行業務、取引関係上の目的等の投資有価証券等において、出資等又は株式等エクスポージャーを保有しています。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い、グループリスクマネジメント会議に報告しております。

ロ)その他有価証券、子会社株式及び関連会社株式の区分ごとのリスク管理の方針

当社グループ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グループ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。

ハ) 株式等エクスポージャーの評価等重要な会計方針

その他有価証券の市場価格のあるもの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)、市場価格のない株式等（非上場株式等）並びに組合出資金等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

主要な子会社及び大和証券グループ本社の保有する金融資産及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、経済価値の変動及び期間収益の変動を算出しております。

12. 連結貸借対照表の科目と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係

【CC2】連結貸借対照表の科目と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係

（単位　百万円）

項目		公表 連結貸借対照表	規制上の連結範囲に基づく 連結貸借対照表	別紙様式第一号 (CC1)の参照項目
資産の部				
流動資産				
現金・預金		4,398,616	4,399,704	
預託金		544,815	544,815	
受取手形、売掛金及び契約資産		29,627	29,627	
有価証券	(a)	1,410,877	1,410,877	8, 18, 39, 54, 72, 73
トレーディング商品	(b)	7,534,999	7,534,999	16, 18, 39, 54, 72, 73
約定見返勘定		－	－	
営業投資有価証券	(c)	138,663	138,663	18, 39, 54, 72, 73
投資損失引当金		▲ 4	▲ 4	
営業貸付金		2,722,321	2,722,321	
仕掛品		839	839	
信用取引資産		158,635	158,635	
有価証券担保貸付金		12,368,472	12,368,472	
立替金		33,633	33,633	
短期貸付金		791	791	
未収収益		88,460	88,601	
繰延税金資産	(d)	－	－	10, 75
その他の流動資産		1,018,117	1,018,519	
貸倒引当金		▲ 9,554	▲ 9,554	
流動資産計		30,439,313	30,440,945	
固定資産				
有形固定資産		921,181	921,214	
無形固定資産		127,602	127,654	
のれん	(e)	17,139	17,139	8
のれん以外	(f)	110,463	110,515	9
投資その他の資産		539,201	538,830	
投資有価証券	(g)	492,226	491,820	8, 18, 39, 54, 72, 73
繰延税金資産	(h)	6,825	6,827	10, 75
上記以外		40,149	40,180	
固定資産計		1,587,986	1,587,701	
繰延資産計		－	－	
資産の部合計		32,027,299	32,028,646	

（単位　百万円）

項目	公表 連結貸借対照表	規制上の連結範囲に基づく 連結貸借対照表	別紙様式第一号 （CC1）の参照項目
負債の部			
流動負債			
支払手形及び買掛金	8,507	8,507	
トレーディング商品	5,863,821	5,863,821	
約定見返勘定	1,457,301	1,457,301	
信用取引負債	54,414	54,414	
有価証券担保借入金	11,698,956	11,698,956	
銀行業における預金	4,511,603	4,511,603	
預り金	562,416	562,423	
受入保証金	522,809	522,809	
短期借入金	1,272,859	1,273,559	
コマーシャルペーパー	440,000	440,000	
1年内償還予定の社債	159,780	159,780	
未払法人税等	42,916	42,916	
繰延税金負債	－	－	
賞与引当金	43,054	43,054	
その他の流動負債	159,110	159,402	
固定負債			
社債	1,276,312	1,276,312	
長期借入金	2,020,812	2,020,812	
繰延税金負債	45,616	45,616	
退職給付に係る負債	43,715	43,715	
訴訟損失引当金	235	235	
負ののれん	－	－	
その他の固定負債	48,761	48,899	
特別法上の準備金	5,637	5,637	
負債の部合計	30,238,640	30,239,778	
純資産の部			
株主資本			
資本金　(i)	247,397	247,397	1a
資本剰余金　(j)	232,461	232,461	1a
利益剰余金　(k)	961,438	961,375	2
自己株式　(l)	▲ 123,153	▲ 123,153	1c
自己株式申込証拠金　(m)	83	83	1c
株主資本合計	1,318,227	1,318,164	
その他の包括利益累計額			
その他有価証券評価差額金	52,936	52,936	
繰延ヘッジ損益　(n)	16,873	16,873	11
為替換算調整勘定	134,149	134,302	
その他の包括利益累計額　(o)	203,959	204,112	3
新株予約権　(p)	6,956	6,956	1b
非支配株主持分　(q)	259,515	259,633	34-35, 48-49
純資産の部合計	1,788,658	1,788,866	

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

【2024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
	日本	9,039,475	1,785,510	1,529,257	5,724,707
	海外	710,916	102,518	123,582	484,815
地域別合計		9,750,391	1,888,028	1,652,840	6,209,522
	ソブリン	5,866,909	1,271,516	1,025,293	3,570,099
	金融機関	1,248,474	132	72,247	1,176,094
	法人	932,998	602,231	159,512	171,253
	CCP	37,447	－	－	37,447
	その他	1,664,562	14,148	395,786	1,254,627
業種別合計		9,750,391	1,888,028	1,652,840	6,209,522
	1年以下	1,666,948	1,458,271	162,725	45,951
	1年超3年以下	219,658	450	216,551	2,656
	3年超5年以下	234,109	1	232,889	1,219
	5年超7年以下	130,521	－	128,865	1,655
	7年超	483,840	－	461,510	22,329
	期間の定めのないもの	7,015,313	429,306	450,296	6,135,710
残存期間別合計		9,750,391	1,888,028	1,652,840	6,209,522

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）

		2024年3月末		
		期末残高	引当金の額	償却額
	日本	56,510	2,803	－
	海外	152	－	－
地域別合計		56,663	2,803	－
	ソブリン	－	－	－
	金融機関	49	－	－
	法人	56,613	2,803	－
	その他	－	－	－
業種別合計		56,663	2,803	－

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
	日本	53,733	25	－	－	53,708
	海外	161	－	－	－	161
地域別合計		53,895	25	－	－	53,869
	ソブリン	0	－	－	－	0
	金融機関	49	－	－	－	49
	法人	53,845	25	－	－	53,819
	CCP	－	－	－	－	－
	その他	－	－	－	－	－
業種別合計		53,895	25	－	－	53,869

ニ) 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. リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーについて、エクスポージャーの区分ごとの額

（単位　百万円）

	エクスポージャーの額
リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（ルック・スルー方式）	543,602
リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（マンデート方式）	35,267
リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式250％）	－
リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式400％）	－
リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（フォールバック方式1250％）	12
合計	578,883

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	
		2024年3月末	2023年3月末	2024年3月末	2023年3月末
1	信用リスク	2,381,958	2,223,767	190,556	177,901
2	うち、標準的手法適用分	1,230,042	1,077,105	98,403	86,168
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	1,151,915	1,146,661	92,153	91,732
4	カウンターパーティ信用リスク	1,467,509	1,280,374	117,400	102,429
5	うち、SA-CCR適用分	501,306	470,396	40,104	37,631
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	－	－	－	－
	うち、CVAリスク	517,561	470,559	41,404	37,644
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	30,878	45,942	2,470	3,675
	その他	417,762	293,476	33,421	23,478
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	－	－	－	－
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（ルック・スルー方式）	305,572	350,430	24,445	28,034
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（マンデート方式）	58,591	29,676	4,687	2,374
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式250%）	－	－	－	－
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式400%）	－	－	－	－
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（フォールバック方式1250%）	161	6,906	12	552
11	未決済取引	23	20	1	1
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	218,562	165,829	17,485	13,266
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	－	－	－	－
14	うち、外部格付準拠方式適用分	183,406	165,829	14,672	13,266
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	－	－	－	－
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	35,156	－	2,812	－
16	マーケット・リスク	1,212,258	1,444,475	96,980	115,558
17	うち、標準的方式適用分	806,970	787,799	64,557	63,023
18	うち、内部モデル方式適用分	405,288	656,675	32,423	52,534
19	オペレーショナル・リスク	1,183,218	1,058,630	94,657	84,690
20	うち、基礎的手法適用分	1,183,218	1,058,630	94,657	84,690
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	259,613	248,592	20,769	19,887
	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	7,087,470	6,808,704	566,997	544,696

（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	
		2024年3月末	2023年12月末	2024年3月末	2023年12月末
1	信用リスク	2,381,958	2,366,320	190,556	189,305
2	うち、標準的手法適用分	1,230,042	1,209,450	98,403	96,756
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	1,151,915	1,156,870	92,153	92,549
4	カウンターパーティ信用リスク	1,467,509	1,339,223	117,400	107,137
5	うち、SA-CCR適用分	501,306	439,400	40,104	35,152
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	－	－	－	－
	うち、CVAリスク	517,561	467,060	41,404	37,364
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	30,878	31,108	2,470	2,488
	その他	417,762	401,653	33,421	32,132
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	－	－	－	－
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（ルック・スルー方式）	305,572	300,111	24,445	24,008
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（マンデート方式）	58,591	60,098	4,687	4,807
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式250%）	－	－	－	－
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式400%）	－	－	－	－
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（フォールバック方式1250%）	161	8,393	12	671
11	未決済取引	23	787	1	62
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	218,562	176,800	17,485	14,144
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	－	－	－	－
14	うち、外部格付準拠方式適用分	183,406	176,800	14,672	14,144
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	－	－	－	－
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	35,156	－	2,812	－
16	マーケット・リスク	1,212,258	1,084,345	96,980	86,747
17	うち、標準的方式適用分	806,970	750,983	64,557	60,078
18	うち、内部モデル方式適用分	405,288	333,362	32,423	26,669
19	オペレーショナル・リスク	1,183,218	1,105,187	94,657	88,415
20	うち、基礎的手法適用分	1,183,218	1,105,187	94,657	88,415
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	259,613	250,546	20,769	20,043
	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	7,087,470	6,691,815	566,997	535,345

【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	4,398,616	4,399,704	4,399,705	－	－	381,093	－
2	預託金	544,815	544,815	544,815	－	－	26,294	－
3	受取手形及び売掛金	29,627	29,627	29,627	－	－	122	－
4	有価証券	1,410,877	1,410,877	1,317,826	－	93,051	808,937	－
5	トレーディング商品	7,534,999	7,534,999	－	2,628,568	－	7,536,410	▲ 1,411
6	約定見返勘定	－	－	－	4,147	－	2,352	14,447
7	営業投資有価証券	138,663	138,663	128,544	－	－	90,789	－
8	投資損失引当金	▲ 4	▲ 4	▲ 4	－	－	－	－
9	営業貸付金	2,722,321	2,722,321	1,907,442	－	814,656	685,667	－
10	仕掛品	839	839	839	－	－	－	－
11	信用取引資産	158,635	158,635	－	158,635	－	－	－
12	有価証券担保貸付金	12,368,472	12,368,472	－	13,402,521	－	5,620,835	－
13	立替金	33,633	33,633	33,683	－	－	170	－
14	短期貸付金	791	791	791	－	－	1,607	－
15	未収収益	88,460	88,601	83,350	－	－	36,350	－
16	繰延税金資産	－	－	－	－	－	－	－
17	その他の流動資産	1,018,117	1,018,519	762,123	84,230	－	146,186	19,383
18	貸倒引当金	▲ 9,554	▲ 9,554	▲ 9,409	－	－	▲ 331	－
19	流動資産計	30,439,313	30,440,945	9,199,335	16,278,102	907,708	15,336,486	32,419
20	有形固定資産	921,181	921,214	921,215	－	－	20,432	－
21	無形固定資産	127,602	127,654	－	－	－	7,650	127,655
22	のれん	17,139	17,139	－	－	－	2,523	17,139
23	のれん以外	110,463	110,515	－	－	－	5,126	110,515
24	投資その他の資産	539,201	538,830	518,501	629	－	151,476	2
25	投資有価証券	492,226	491,820	471,173	－	－	81,800	－
26	繰延税金資産	6,825	6,827	6,825	－	－	3,761	2
27	上記以外	40,149	40,180	40,502	629	－	65,914	－
28	固定資産計	1,587,986	1,587,701	1,439,717	629	－	179,559	127,658
29	繰延資産計	－	－	－	－	－	－	－
30	資産合計	32,027,299	32,028,646	10,639,052	16,278,732	907,708	15,516,045	160,077

（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。

LI1 その2

（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
	負債							
31	支払手形及び買掛金	8,507	8,507	－	－	－	－	8,507
32	トレーディング商品	5,863,821	5,863,821	－	2,479,420	－	5,863,821	－
33	約定見返勘定	1,457,301	1,457,301	－	－	－	474,227	－
34	信用取引負債	54,414	54,414	－	54,414	－	－	－
35	有価証券担保借入金	11,698,956	11,698,956	－	12,733,005	－	7,673,968	－
36	銀行業における預金	4,511,603	4,511,603	－	－	－	－	4,511,603
37	預り金	562,416	562,423	－	－	－	55,035	562,424
38	受入保証金	522,809	522,809	－	5,912	－	223	522,809
39	短期借入金	1,272,859	1,273,559	－	－	－	162,786	1,273,559
40	コマーシャルペーパー	440,000	440,000	－	－	－	－	440,000
41	1年以内償還予定の社債	159,780	159,780	－	－	－	－	159,780
42	未払法人税等	42,916	42,916	－	－	－	817	42,916
43	繰延税金負債	－	－	－	－	－	－	－
44	賞与引当金	43,054	43,054	－	－	－	19,902	43,054
45	その他の流動負債	159,110	159,402	955	25,369	－	92,657	128,189
46	社債	1,276,312	1,276,312	－	－	－	260	1,276,312
47	長期借入金	2,020,812	2,020,812	－	－	－	－	2,020,812
48	繰延税金負債	45,616	45,616	－	－	－	12	45,445
49	退職給付に係る負債	43,715	43,715	－	－	－	－	43,715
50	訴訟損失引当金	235	235	－	－	－	－	235
51	負ののれん	－	－	－	－	－	－	－
52	その他の固定負債	48,761	48,899	－	62	－	10,305	39,736
53	特別法上の準備金	5,637	5,637	－	－	－	－	5,637
54	負債合計	30,238,640	30,239,778	955	15,298,184	－	14,354,019	11,124,739

（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	31,868,568	10,639,052	16,278,732	907,708	15,516,045
2	自己資本比率規制上の連結範囲に基づく負債の額	19,115,040	955	15,298,184	－	14,354,019
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	12,753,528	10,638,097	980,547	907,708	1,162,026
4	オフ・バランスシートの額	1,094,663	67,644	1,027,019	－	－
5	保守的な公正価値調整による差異	－	－	－	－	－
6	ネッティ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	デリバティブ取引等による差異	4,118,152	－	4,118,152	－	－
10	レポ形式の取引について、ネッティ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	25,399,781	－	25,399,781	－	－
11	その他の差異	▲ 27,662,221	▲ 500,452	▲ 28,117,074	20,454	－
12	自己資本比率規制上のエクスポージャーの額	15,703,904	10,205,289	3,408,426	928,163	1,162,026

（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ティングがなされたものが、カウンターパーティー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ティ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	29,851	1,869,475	11,298	1,888,028
2	有価証券（うち負債性のもの）	－	1,226,149	－	1,226,149
3	その他オン・バランスシートの資産（うち負債性のもの）	26,821	4,564,281	817	4,590,286
4	オン・バランスシートの資産の合計（1＋2＋3）	56,673	7,659,906	12,115	7,704,464
	オフ・バランスシートの資産				
5	支払承諾等	－	51,492	－	51,492
6	コミットメント等	－	－	－	－
7	オフ・バランスシートの資産の合計（5＋6）	－	51,492	－	51,492
	合計				
8	合計（4＋7）	56,673	7,711,399	12,115	7,755,956

（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。

【CR2】デフォルトした貸出金・有価証券等（うち負債性のもの）の残高の変動

（単位　百万円）

	前期末:2023年9月末 当期末:2024年3月末		額
1	前期末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等（うち負債性のもの）の残高		33,760
2	貸出金・有価証券等（うち負債性のもの）の当期中の要因別の変動額	デフォルトした額	－
3		非デフォルト状態へ復帰した額	－
4		償却された額	－
5		その他の変動額	22,912
6	当期末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等（うち負債性のもの）の残高（1＋2－3－4＋5）		56,673

（注）「その他の変動額」に記載の変動額のうち、主な発生要因としてはデフォルト状態にあるエクスポージャーの追加与信による残高増加が挙げられます。

【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	1,329,132	558,896	295,836	263,060	－
2	有価証券（負債性のもの）	1,126,639	99,509	－	99,509	－
3	その他オン・バランスシートの資産（負債性のもの）	4,590,278	7	7	－	－
4	合計（1+2+3）	7,046,050	658,413	295,844	362,569	－
5	うちデフォルトしたもの	53,869	－	－	－	－

【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、%）

		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）
	資産クラス	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	4,665,474	–	4,665,474	–	–	0.00%
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	442,520	–	442,520	–	13	0.00%
4	国際決済銀行等向け	–	–	–	–	–	–
5	我が国の地方公共団体向け	61,756	–	61,756	–	–	0.00%
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	3,600	–	3,600	–	756	21.01%
7	国際開発銀行向け	7,244	–	7,244	–	–	0.00%
8	地方公共団体金融機構向け	16,779	–	16,779	–	3,343	19.93%
9	我が国の政府関係機関向け	669,531	–	669,531	–	32,574	4.87%
10	地方三公社向け	1	–	1	–	0	20.00%
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	1,249,513	7,570	1,249,513	7,570	264,697	21.06%
12	法人等向け	863,231	19,974	567,387	19,974	516,469	87.93%
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	14,149	7,987	14,149	7,987	22,137	100.00%
16	三月以上延滞等（抵当権付住宅ローンを除く。）	53,869	–	53,869	–	80,804	150.00%
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。）	299,221	19,499	299,221	9,749	309,246	100.09%
22	合計	8,346,894	55,032	8,051,050	45,282	1,230,042	15.19%

【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）

		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 / 資産クラス	0%	10%	20%	35%	50%	75%
1	現金	－	－	－	－	－	－
2	日本国政府及び日本銀行向け	4,665,474	－	－	－	－	－
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	442,492	－	6	－	18	－
4	国際決済銀行等向け	－	－	－	－	－	－
5	我が国の地方公共団体向け	61,756	－	－	－	－	－
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	－	－	3,554	－	－	－
7	国際開発銀行向け	7,244	－	－	－	－	－
8	地方公共団体金融機構向け	－	123	16,655	－	－	－
9	我が国の政府関係機関向け	362,569	288,182	18,779	－	－	－
10	地方三公社向け	－	－	1	－	－	－
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	－	－	1,233,961	－	10,434	－
12	法人等向け	－	－	38,989	－	79,401	－
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。）	－	－	－	－	0	－
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	5,539,537	288,306	1,311,949	－	89,854	－

CR5 その2

（単位　百万円）

		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 / 資産クラス	100%	150%	250%	1250%	合計
1	現金	－	－	－	－	－
2	日本国政府及び日本銀行向け	－	－	－	－	4,665,474
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	2	－	－	－	442,520
4	国際決済銀行等向け	－	－	－	－	－
5	我が国の地方公共団体向け	－	－	－	－	61,756
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	45	－	－	－	3,600
7	国際開発銀行向け	－	－	－	－	7,244
8	地方公共団体金融機構向け	－	－	－	－	16,779
9	我が国の政府関係機関向け	－	－	－	－	669,531
10	地方三公社向け	－	－	－	－	1
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	12,687	－	－	－	1,257,083
12	法人等向け	468,970	－	－	－	587,362
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	22,137	－	－	－	22,137
16	三月以上延滞等（抵当権付住宅ローンを除く。）	－	53,869	－	－	53,869
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。）	308,948	－	－	23	308,971
22	合計	812,791	53,869	－	23	8,096,332

【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）

		RC	PFE	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	270,124	308,262		1.4	809,741	501,306
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					1,621,763	417,762
5	エクスポージャー変動推計モデル					－	－
6	合計						919,069

【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	720,650	517,561
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	720,650	517,561

【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	935,395	－	－
2	外国の中央政府及び中央銀行向け	14,437	－	8,984
3	国際決済銀行等向け	34,711	－	－
4	我が国の地方公共団体向け	1,458	－	－
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け	－	－	58,997
6	国際開発銀行向け	12,643	－	－
7	地方公共団体金融機構向け	－	－	2,919
8	我が国の政府関係機関向け	－	16,639	11,994
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	－	－	495,225
11	法人等向け	－	－	14,816
12	中小企業等向け及び個人向け	－	－	－
13	上記以外	－	－	－
14	合計	998,646	16,639	592,939

（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	304	－	－
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	1,326	－	－
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	5,244	－	－
11	法人等向け	43,224	－	772,007
12	中小企業等向け及び個人向け	－	－	－
13	上記以外	－	－	－
14	合計	50,099	－	772,007

CCR3 その2

（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）		
		150%	その他	合計
1	日本国政府及び日本銀行向け	－	－	935,395
2	外国の中央政府及び中央銀行向け	－	－	23,727
3	国際決済銀行等向け	－	－	34,711
4	我が国の地方公共団体向け	－	－	1,458
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け	－	－	60,324
6	国際開発銀行向け	－	－	12,643
7	地方公共団体金融機構向け	－	－	2,919
8	我が国の政府関係機関向け	－	－	28,633
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	－	－	500,469
11	法人等向け	1,173	－	831,222
12	中小企業等向け及び個人向け	－	－	－
13	上記以外	－	－	－
14	合計	1,173	－	2,431,505

【CCR5】担保の内訳

（単位　百万円）

		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）	37,957	298,906	39,237	433,810	5,488,187	6,790,013
2	現金（その他通貨）	6,692	82,244	11,476	15,530	8,281,068	6,823,174
3	国内ソブリン債	16,220	15,094	19,827	－	5,389,448	4,530,034
4	その他ソブリン債	15,442	－	－	－	6,231,946	6,219,670
5	政府関係機関債	1,327	－	－	－	937,299	2,396,643
6	社債	62,098	－	－	－	55,820	245,374
7	株式	23,793	－	－	14,556	644,552	424,782
8	その他担保	1,859	－	－	－	21,668	1,384,042
9	合計	165,393	396,246	70,541	463,897	27,049,990	28,813,736

（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	595,972	898,118
2	インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ	2,609,770	2,520,574
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	3,205,742	3,418,693
	公正価値		
7	プラスの公正価値（資産）	2,078	59,722
8	マイナスの公正価値（負債）	▲ 57,576	▲ 4,120

【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）		30,878
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。）	862,283	17,174
3	（ｉ）派生商品取引（上場以外）	290,650	5,813
4	（ii）派生商品取引（上場）	263,227	5,264
5	（iii）レポ形式の取引	308,406	6,096
6	（iv）クロスプロダクト・ネッティングが承認された場合のネッティング・セット	－	－
7	分別管理されている当初証拠金	66,949	
8	分別管理されていない当初証拠金	20,064	401
9	事前拠出された清算基金	27,622	13,302
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・ネッティングが承認された場合のネッティング・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）	339,014	－	339,014
2	担保付住宅ローン	164,496	－	164,496
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	174,517	－	174,517
5	再証券化	－	－	－
6	ホールセール（合計）	589,148	－	589,148
7	事業法人向けローン	575,901	－	575,901
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	13,247	－	13,247
10	その他のホールセール	－	－	－
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）	646	－	646
2	担保付住宅ローン	646	－	646
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）	－	－	－
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	－	－	－

【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	925,350	925,350	925,350	336,201	589,148
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	2,812	2,812	2,812	2,812	–
	エクスポージャーの額（算出方法別）					
6	内部格付手法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	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	925,350	925,350	925,350	336,201	589,148
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	–	–	–	–	–
9	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	2,812	2,812	2,812	2,812	–
	信用リスク・アセットの額（算出方法別）					
10	内部格付手法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	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	183,406	183,406	183,406	65,602	117,803
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	–	–	–	–	–
13	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	35,156	35,156	35,156	35,156	–
	所要自己資本の額（算出方法別）					
14	内部格付手法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	外部格付準拠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	14,672	14,672	14,672	5,248	9,424
16	標準的手法準拠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	–	–	–	–	–
17	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	2,812	2,812	2,812	2,812	–

SEC4 その2

（単位　百万円）

		合計				
		資産譲渡型証券化取引（小計）			合成型証券化取引（小計）	証券化
		再証券化				
			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	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	－	－	－	－	－
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	－	－	－	－	－
9	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	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	－	－	－	－	－
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	－	－	－	－	－
13	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	外部格付準拠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	標準的手法準拠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	－	－	－	－	－
17	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	－	－	－	－	－

SEC4 その3　　（単位　百万円）

		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	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
9	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	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
13	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	外部格付準拠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	標準的手法準拠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	-	-	-	-	-
17	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		522,605
2	株式リスク（一般市場リスク及び個別リスク）の額		77,638
3	外国為替リスクの額		201,943
4	コモディティ・リスクの額		597
	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		4,185
9	合計		806,970

【MR2】内部モデル方式を適用して算出されたリスク・アセットの額の変動要因

（単位　百万円）

	前期末:2023年3月末 当期末:2024年3月末		バリュー・アット・リスク	ストレス・バリュー・アット・リスク	追加的リスク	包括的リスク	その他	合計
1a	前期末におけるリスク・アセット		168,932	487,742	－	－		656,675
1b	前期末における連結自己資本規制上のリスク・アセット額への調整		4.14	3.69	－	－		3.80
1c	前期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額		40,728	132,018	－	－		172,747
2	当期中の要因別の変動額	リスク量の変動	10,479	▲ 59,014	－	－		▲ 48,534
3		モデルの更新又は変更	－	－	－	－		－
4		手法及び方針	－	－	－	－		－
5		買収及び売却	－	－	－	－		－
6		為替の変動	－	－	－	－		－
7		その他	－	－	－	－		－
8a	当期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額		51,207	73,004	－	－		124,212
8b	当期末における連結自己資本規制上のリスク・アセット額への調整		2.36	3.89	－	－		3.26
8c	当期末におけるリスク・アセット		121,090	284,197	－	－		405,288

（単位　百万円）

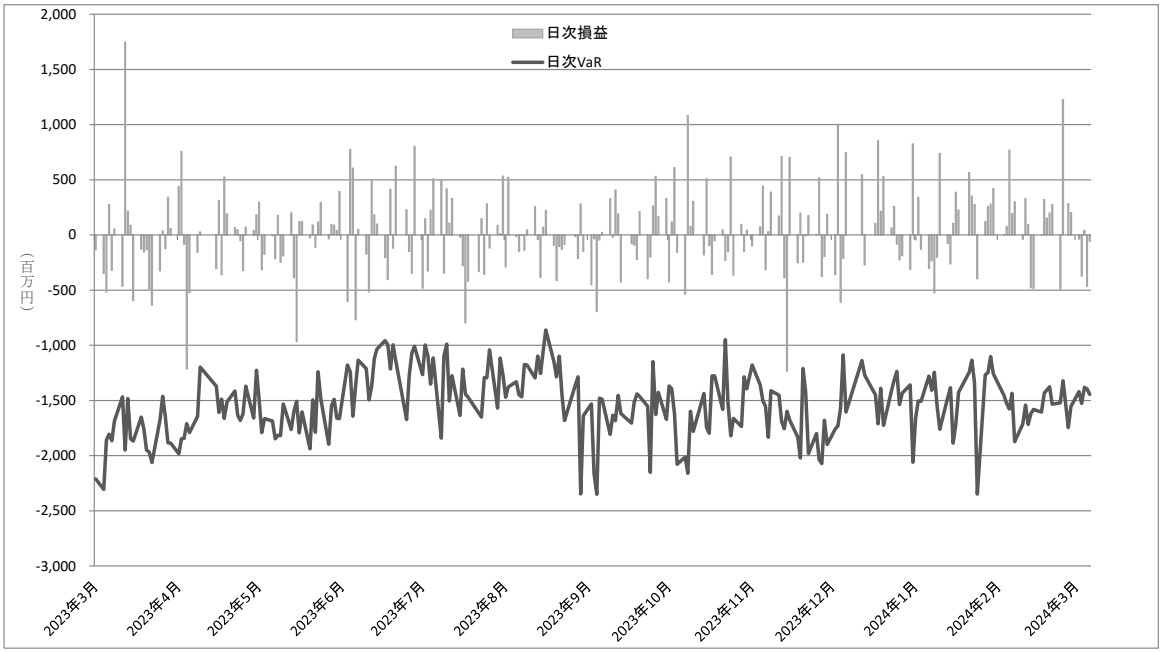
	前四半期末:2023年12月末 当四半期末:2024年3月末		バリュー・アット・リスク	ストレス・バリュー・アット・リスク	追加的リスク	包括的リスク	その他	合計
1a	前四半期末におけるリスク・アセット		131,173	202,189	－	－		333,362
1b	前四半期末における連結自己資本規制上のリスク・アセット額への調整		4.22	2.50	－	－		2.98
1c	前四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額		31,054	80,753	－	－		111,808
2	当四半期の要因別の変動額	リスク量の変動	20,153	▲ 7,749	－	－		12,404
3		モデルの更新又は変更	－	－	－	－		－
4		手法及び方針	－	－	－	－		－
5		買収及び売却	－	－	－	－		－
6		為替の変動	－	－	－	－		－
7		その他	－	－	－	－		－
8a	当四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額		51,207	73,004	－	－		124,212
8b	当四半期末における連結自己資本規制上のリスク・アセット額への調整		2.36	3.89	－	－		3.26
8c	当四半期末におけるリスク・アセット		121,090	284,197	－	－		405,288

【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	5,220
2	平均値	2,836
3	最小値	1,294
4	期末	4,075
	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	12,214
6	平均値	6,779
7	最小値	1,376
8	期末	5,754
	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・テスティングの結果



【IRRBB1】金利リスク

（単位　百万円）

		⊿EVE	
		2024年3月末	2023年3月末
1	上方パラレルシフト	13,703	8,343
2	下方パラレルシフト	24,556	20,114
3	スティープ化	9,257	10,375
4	フラット化	530	454
5	短期金利上昇	4,219	1,033
6	短期金利低下	14,431	13,420
7	最大値	24,556	20,114
		2024年3月末	2023年3月末
8	Tier1 資本の額	1,520,820	1,429,860

（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。

【CCyB1】カウンター・シクリカル・バッファー比率に係る国又は地域別の状況

（単位　百万円）

国又は地域	各金融当局が定める比率	カウンター・シクリカル・バッファー比率の計算に用いた当該国又は地域に係る信用リスク・アセットの額	カウンター・シクリカル・バッファー比率	カウンター・シクリカル・バッファーの額
オーストラリア	1.00%	54,307		
フランス	1.00%	606		
ドイツ	0.75%	0		
香港	1.00%	9,702		
ルクセンブルク	0.50%	31,716		
オランダ	1.00%	27,250		
スウェーデン	2.00%	3		
英国	2.00%	102,210		
小計		225,798		
合計		3,579,156	0.08%	6,181

(注)「カウンター・シクリカル・バッファー比率の計算に用いた当該国又は地域に係る信用リスク・アセットの額」については原則最終リスクベースでの算出を行っていますが、一部最終リスク国の把握が実態的に困難な資産については、記帳地を用いて算出を行っています。

■ 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	2024年3月末	2023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	13,213,263	12,575,527
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	28,483,230	23,326,212
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。）	1,347	1,275
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（△）	15,271,314	10,751,960
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額（△）	161,564	156,204
3		オン・バランス資産の額　（イ）	13,051,699	12,419,323
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RC の額に1.4 を乗じた額	907,812	810,369
5		デリバティブ取引等に関するPFE の額に1.4 を乗じた額	605,842	835,622
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差し入れた担保の対価の額	－	－
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（△）	103,733	26,952
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	3,418,693	2,386,360
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（△）	3,020,666	1,974,603
11	4	デリバティブ取引等に関する額　（ロ）	1,807,948	2,030,796
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	13,719,164	10,031,640
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額（△）	4,431,088	2,564,118
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	196,262	170,862
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）	9,484,338	7,638,384
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	165,623	152,809
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（△）	47,852	46,086
19	6	オフ・バランス取引に関する額　（ニ）	117,771	106,723
連結レバレッジ比率		（5）		
20		資本の額　（ホ）	1,520,820	1,429,859
21	8	総エクスポージャーの額（（イ）＋（ロ）＋（ハ）＋（ニ））　（ヘ）	24,461,756	22,195,226
22		連結レバレッジ比率（（ホ）／（ヘ））	6.21%	6.44%
		適用する所要連結レバレッジ比率	3.00%	－
		適用する所要連結レバレッジ・バッファー比率	－	－
日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率		（6）		
		総エクスポージャーの額　（ヘ）	24,461,756	22,195,226
		日本銀行に対する預け金の額	3,544,069	3,087,036
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーの額　（ヘ’）	28,005,825	25,282,262
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率（（ホ）／（ヘ’））	5.43%	5.65%

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

【CCA】自己資本等の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
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	―
	規制上の取り扱い (2)	
4	2022年3月30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	2022年3月31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 (3)	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 (4)	
	連結自己資本規制比率	1,283,131 百万円
9	額面総額 (5)	―
10	表示される科目の区分 (6)	
	連結貸借対照表	株主資本
11	発行日 (7)	―
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 (8)	―
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	―
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 (10)	―
	剰余金の配当又は利息の支払	
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動
18	配当率又は利率 (12)	―
19	配当等停止条項の有無 (13)	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 (14)	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 (15)	―
25	転換の範囲 (16)	―
26	転換の比率 (17)	―
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	―
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 (19)	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	―
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	―
33	元本回復特約の有無 (22)	―
34	その概要	―
34a	劣後性の手段(23)	―
35	残余財産の分配又は倒産手続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又はその他外部TLAC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 (24)	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	―

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
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	―	―
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30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	2022年3月31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 (3)	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 (4)		
	連結自己資本規制比率	43 百万円	56 百万円
9	額面総額 (5)	―	―
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2006年7月1日	2007年7月1日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	―	―
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 (8)	―	―
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	―	―
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 (10)	―	―
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	―	―
19	配当等停止条項の有無 (13)	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 (14)	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 (15)	―	―
25	転換の範囲 (16)	―	―
26	転換の比率 (17)	―	―
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	―	―
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 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	―	―
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	―	―
33	元本回復特約の有無 (22)	―	―
34	その概要	―	―
34a	劣後性の手段(23)	―	―
35	残余財産の分配又は倒産手続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又はその他外部TLAC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 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	―	―

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
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	－	－
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30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	2022年3月31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 (3)	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	2009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 (4)		
	連結自己資本規制比率	70 百万円	123 百万円
9	額面総額 (5)	－	－
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2008年7月1日	2009年7月1日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	－	－
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 (8)	－	－
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	－	－
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 (10)	－	－
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	－	－
19	配当等停止条項の有無 (13)	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 (14)	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 (15)	－	－
25	転換の範囲 (16)	－	－
26	転換の比率 (17)	－	－
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	－	－
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 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	－	－
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	－	－
33	元本回復特約の有無 (22)	－	－
34	その概要	－	－
34a	劣後性の手段(23)	－	－
35	残余財産の分配又は倒産手続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又はその他外部TLAC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 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	－	－

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
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	－	－
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30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	2022年3月31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 (3)	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	2011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 (4)		
	連結自己資本規制比率	174 百万円	276 百万円
9	額面総額 (5)	－	－
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2010年7月1日	2011年7月1日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	－	－
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 (8)	－	－
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	－	－
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 (10)	－	－
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	－	－
19	配当等停止条項の有無 (13)	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 (14)	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 (15)	－	－
25	転換の範囲 (16)	－	－
26	転換の比率 (17)	－	－
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	－	－
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 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	－	－
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	－	－
33	元本回復特約の有無 (22)	－	－
34	その概要	－	－
34a	劣後性の手段(23)	－	－
35	残余財産の分配又は倒産手続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又はその他外部TLAC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 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	－	－

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
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	－	－
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30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	2022年3月31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 (3)	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	2014年2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 (4)		
	連結自己資本規制比率	340 百万円	293 百万円
9	額面総額 (5)	－	－
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2013年2月12日	2014年2月10日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	－	－
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 (8)	－	－
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	－	－
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 (10)	－	－
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	－	－
19	配当等停止条項の有無 (13)	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 (14)	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 (15)	－	－
25	転換の範囲 (16)	－	－
26	転換の比率 (17)	－	－
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	－	－
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 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	－	－
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	－	－
33	元本回復特約の有無 (22)	－	－
34	その概要	－	－
34a	劣後性の手段(23)	－	－
35	残余財産の分配又は倒産手続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又はその他外部TLAC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 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	－	－

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
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	－	－
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30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	2022年3月31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 (3)	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 (4)		
	連結自己資本規制比率	335 百万円	563 百万円
9	額面総額 (5)	－	－
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2015年2月9日	2015年2月9日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	－	－
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 (8)	－	－
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	－	－
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 (10)	－	－
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	－	－
19	配当等停止条項の有無 (13)	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 (14)	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 (15)	－	－
25	転換の範囲 (16)	－	－
26	転換の比率 (17)	－	－
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	－	－
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 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	－	－
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	－	－
33	元本回復特約の有無 (22)	－	－
34	その概要	－	－
34a	劣後性の手段(23)	－	－
35	残余財産の分配又は倒産手続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又はその他外部TLAC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 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	－	－

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
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	－	－
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30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	2022年3月31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 (3)	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 (4)		
	連結自己資本規制比率	348 百万円	238 百万円
9	額面総額 (5)	－	－
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2016年2月16日	2016年2月16日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	－	－
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 (8)	－	－
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	－	－
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 (10)	－	－
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	－	－
19	配当等停止条項の有無 (13)	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 (14)	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 (15)	－	－
25	転換の範囲 (16)	－	－
26	転換の比率 (17)	－	－
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	－	－
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 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	－	－
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	－	－
33	元本回復特約の有無 (22)	－	－
34	その概要	－	－
34a	劣後性の手段(23)	－	－
35	残余財産の分配又は倒産手続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又はその他外部TLAC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 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	－	－

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
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	－	－
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30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	2022年3月31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 (3)	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 (4)		
	連結自己資本規制比率	375 百万円	496 百万円
9	額面総額 (5)	－	－
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2017年2月8日	2017年2月8日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	－	－
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 (8)	－	－
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	－	－
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 (10)	－	－
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	－	－
19	配当等停止条項の有無 (13)	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 (14)	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 (15)	－	－
25	転換の範囲 (16)	－	－
26	転換の比率 (17)	－	－
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	－	－
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 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	－	－
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	－	－
33	元本回復特約の有無 (22)	－	－
34	その概要	－	－
34a	劣後性の手段(23)	－	－
35	残余財産の分配又は倒産手続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又はその他外部TLAC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 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	－	－

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
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	－	－
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30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	2022年3月31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 (3)	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 (4)		
	連結自己資本規制比率	409 百万円	590 百万円
9	額面総額 (5)	－	－
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2018年2月8日	2018年2月8日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	－	－
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 (8)	－	－
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	－	－
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 (10)	－	－
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	－	－
19	配当等停止条項の有無 (13)	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 (14)	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 (15)	－	－
25	転換の範囲 (16)	－	－
26	転換の比率 (17)	－	－
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	－	－
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 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	－	－
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	－	－
33	元本回復特約の有無 (22)	－	－
34	その概要	－	－
34a	劣後性の手段(23)	－	－
35	残余財産の分配又は倒産手続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又はその他外部TLAC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 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	－	－

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
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	－	－
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30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	2022年3月31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 (3)	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	第15回新株予約権	第16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 (4)		
	連結自己資本規制比率	407 百万円	436 百万円
9	額面総額 (5)	－	－
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2018年8月10日	2019年8月15日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	－	－
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 (8)	－	－
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	－	－
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 (10)	－	－
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	－	－
19	配当等停止条項の有無 (13)	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 (14)	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 (15)	－	－
25	転換の範囲 (16)	－	－
26	転換の比率 (17)	－	－
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	－	－
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 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	－	－
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	－	－
33	元本回復特約の有無 (22)	－	－
34	その概要	－	－
34a	劣後性の手段(23)	－	－
35	残余財産の分配又は倒産手続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又はその他外部TLAC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 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	－	－

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
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	―	―
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30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	2022年3月31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 (3)	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	第17回新株予約権	第18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 (4)		
	連結自己資本規制比率	444 百万円	262 百万円
9	額面総額 (5)	―	―
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2020年8月17日	2021年8月13日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	―	―
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 (8)	―	―
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	―	―
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 (10)	―	―
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	―	―
19	配当等停止条項の有無 (13)	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 (14)	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 (15)	―	―
25	転換の範囲 (16)	―	―
26	転換の比率 (17)	―	―
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	―	―
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 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	―	―
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	―	―
33	元本回復特約の有無 (22)	―	―
34	その概要	―	―
34a	劣後性の手段(23)	―	―
35	残余財産の分配又は倒産手続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又はその他外部TLAC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 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	―	―

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
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	－	－
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30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	2022年3月31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 (3)	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	第19回新株予約権	第20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 (4)		
	連結自己資本規制比率	376 百万円	292 百万円
9	額面総額 (5)	－	－
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2022年8月15日	2023年8月15日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	－	－
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 (8)	－	－
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	－	－
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 (10)	－	－
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	－	－
19	配当等停止条項の有無 (13)	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 (14)	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 (15)	－	－
25	転換の範囲 (16)	－	－
26	転換の比率 (17)	－	－
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	－	－
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 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	－	－
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	－	－
33	元本回復特約の有無 (22)	－	－
34	その概要	－	－
34a	劣後性の手段(23)	－	－
35	残余財産の分配又は倒産手続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又はその他外部TLAC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 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	－	－

1	発行者	大和証券オフィス投資法人	サムティ・レジデンシャル投資法人
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	―	―
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	―	―
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30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	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	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	2022年3月31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	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 (3)	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	普通株式	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 (4)		
	連結自己資本規制比率	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 30,517百万円 Tier2資本に係る基礎項目の額 7,180百万円	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 9,380百万円 Tier2資本に係る基礎項目の額 2,207百万円
9	額面総額 (5)	―	―
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	非支配株主持分	非支配株主持分
11	発行日 (7)	―	―
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	―	―
14	償還等を可能とする特約の有無	―	―
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	―	―
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	―	―
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 (10)	―	―
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	―	―
19	配当等停止条項の有無 (13)	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 (14)	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 (15)	―	―
25	転換の範囲 (16)	―	―
26	転換の比率 (17)	―	―
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	―	―
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 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	―	―
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	―	―
33	元本回復特約の有無 (22)	―	―
34	その概要	―	―
34a	劣後性の手段(23)	―	―
35	残余財産の分配又は倒産手続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又はその他外部TLAC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 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	―	―

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	JP350220AL30	JP350220BL39
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	―	―
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30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	その他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
5	2022年3月31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	その他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 (3)	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	第1回任意償還条項付無担保永久社債 (債務免除特約および劣後特約付)	第2回任意償還条項付無担保永久社債 (債務免除特約および劣後特約付)
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	124,900 百万円	25,000 百万円
9	額面総額 (5)	125,000 百万円	25,000 百万円
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	負債	負債
11	発行日 (7)	2020年3月16日	2020年3月16日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	―	―
14	償還等を可能とする特約の有無	有	有
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	2025年6月5日:元本全額償還	2030年6月5日:元本全額償還
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	税務事由又は資本事由:元本全額償還	税務事由又は資本事由:元本全額償還
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 (10)	初回償還可能日以降の各利払日	初回償還可能日以降の各利払日
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	固定から変動	固定から変動
18	配当率又は利率 (12)	2020年3月16日の翌日から2025年6月5日まで: 年1.20パーセント 2025年6月5日の翌日以降: 6か月ユーロ円LIBOR＋1.40パーセント	2020年3月16日の翌日から2030年6月5日まで: 年1.39パーセント 2030年6月5日の翌日以降: 6か月ユーロ円LIBOR＋1.50パーセント
19	配当等停止条項の有無 (13)	有	有
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 (14)	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 (15)	―	―
25	転換の範囲 (16)	―	―
26	転換の比率 (17)	―	―
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	―	―
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 (19)	有	有
31	元本の削減が生じる場合 (20)	・当社が報告又は公表する連結普通株式等Tier1比率が5.125%を下回った場合 ・内閣総理大臣が当社について、預金保険法第126条の2第1項第2号に定める措置である特定第二号措置を講ずる必要がある旨の認定を行った場合 ・当社について倒産手続の開始の決定等がなされた場合	・当社が報告又は公表する連結普通株式等Tier1比率が5.125%を下回った場合 ・内閣総理大臣が当社について、預金保険法第126条の2第1項第2号に定める措置である特定第二号措置を講ずる必要がある旨の認定を行った場合 ・当社について倒産手続の開始の決定等がなされた場合
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	全部削減又は一部削減	全部削減又は一部削減
33	元本回復特約の有無 (22)	有	有
34	その概要	元金回復がなされた直後においても十分に高い水準の連結普通株式等Tier1比率が維持されることについて、あらかじめ金融庁その他の監督当局の確認を受けたうえで、当社が元金の支払義務の免除の効力を将来に向かって消滅させることを決定する場合	元金回復がなされた直後においても十分に高い水準の連結普通株式等Tier1比率が維持されることについて、あらかじめ金融庁その他の監督当局の確認を受けたうえで、当社が元金の支払義務の免除の効力を将来に向かって消滅させることを決定する場合
34a	劣後性の手段(23)	契約上の劣後	契約上の劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続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又はその他外部TLAC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 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	―	―

以　上