

2024年10月29日

各 位

会社名 株式会社大和証券グループ本社

代表者名 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6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6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  |
| ■  | 自己資本調達手段に関する契約内容の概要.....           | 7  |
| ■  | 定量的な開示事項.....                      | 21 |
| 1. | その他定量的な開示事項.....                   | 21 |
| ■  | 連結レバレッジ比率に関する開示事項.....             | 23 |
| 1. | 連結レバレッジ比率の構成に関する開示.....            | 23 |
| 2. | 前四半期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..... | 23 |

## ■ 主要な指標

### 【KM1】 主要な指標

(単位 百万円、%)

| 国際様式<br>の<br>該当番号 |                         | 2024年<br>6月末 | 2024年<br>3月末 | 2023年<br>12月末 | 2023年<br>9月末 | 2023年<br>6月末 |
|-------------------|-------------------------|--------------|--------------|---------------|--------------|--------------|
| 資本                |                         |              |              |               |              |              |
| 1                 | 普通株式等Tier1<br>資本の額      | 1,367,678    | 1,331,138    | 1,299,914     | 1,308,028    | 1,305,377    |
| 2                 | Tier1資本の額               | 1,554,875    | 1,520,820    | 1,489,647     | 1,495,881    | 1,491,860    |
| 3                 | 総自己資本の額                 | 1,557,238    | 1,529,866    | 1,498,996     | 1,502,097    | 1,495,580    |
| リスク・アセット          |                         |              |              |               |              |              |
| 4                 | リスク・アセットの額              | 7,426,777    | 7,087,470    | 6,691,815     | 6,789,921    | 6,931,589    |
| 自己資本比率            |                         |              |              |               |              |              |
| 5                 | 連結普通株式等<br>Tier1比率      | 18.41%       | 18.78%       | 19.42%        | 19.26%       | 18.83%       |
| 6                 | 連結Tier1比率               | 20.93%       | 21.45%       | 22.26%        | 22.03%       | 21.52%       |
| 7                 | 連結総自己資本<br>比率           | 20.96%       | 21.58%       | 22.40%        | 22.12%       | 21.57%       |
| 資本バッファー           |                         |              |              |               |              |              |
| 8                 | 資本保全バッファー<br>比率         | 2.50%        | 2.50%        | 2.50%         | 2.50%        | 2.50%        |
| 9                 | カウンター・シクリカ<br>ル・バッファー比率 | 0.10%        | 0.08%        | 0.08%         | 0.08%        | 0.05%        |
| 10                | G-SIB/D-SIBバッ<br>ファー比率  | 0.50%        | 0.50%        | 0.50%         | 0.50%        | 0.50%        |
| 11                | 最低連結資本バッ<br>ファー比率       | 3.10%        | 3.08%        | 3.08%         | 3.08%        | 3.05%        |
| 12                | 連結資本バッファー<br>比率         | 12.96%       | 13.58%       | 14.40%        | 14.12%       | 13.57%       |
| 連結レバレッジ比率         |                         |              |              |               |              |              |
| 13                | 総エクスポージャー<br>の額         | 28,623,154   | 24,461,756   | 24,439,442    | 27,268,928   | 26,077,120   |
| 14                | 連結レバレッジ比率               | 5.43%        | 6.21%        | 6.09%         | 5.48%        | 5.72%        |

## ■ 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<br>該当番号           | 項目                                             | 当最終指定親会<br>社四半期末 | 別紙様式第八号<br>(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                                  | 1,310,736        |                       |
| 1a                      | うち、資本金及び資本剰余金の額                                | 480,873          | (i), (j)              |
| 2                       | うち、利益剰余金の額                                     | 950,294          | (k)                   |
| 1c                      | うち、自己株式の額 (△)                                  | 120,431          | (l), (m)              |
| 26                      | うち、社外流出予定額 (△)                                 | -                |                       |
|                         | 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                                 | 6,347            | (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                        | 237,865          | (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)                      | 1,554,949        |                       |
| 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        | 160,447          |                       |
| 8                       | うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額                     | 48,493           | (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           | 111,954          | (f)                   |
| 10                      | 繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額                        | 260              | (d), (h)              |
| 11                      | 繰延ヘッジ損益の額                                      | 496              | (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             | 626              |                       |
| 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                  | 135              | (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                               | 25,304           | (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)                      | 187,271          |                       |
| 普通株式等Tier1資本            |                                                |                  |                       |
| 29                      | 普通株式等Tier1資本の額 ((イ) - (ロ)) (ハ)                 | 1,367,678        |                       |

(単位 百万円、%)

| 国際様式の<br>該当番号         | 項目                                                  | 当最終指定親会<br>社四半期末 | 別紙様式第八号<br>(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                            | 149,400          |                       |
|                       | 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                          | 40,272           | (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 (二)                             | 189,672          |                       |
| 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                          | 2,474            | (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)                             | 2,474            |                       |
| その他Tier1資本            |                                                     |                  |                       |
| 44                    | その他Tier1資本の額 ((二) - (ホ)) (ヘ)                        | 187,197          |                       |
| Tier1資本               |                                                     |                  |                       |
| 45                    | Tier1資本の額 ((ハ) + (ヘ)) (ト)                           | 1,554,875        |                       |
| 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                             | 9,475            | (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)                                | 9,475            |                       |

(単位 百万円、%)

| 国際様式の<br>該当番号                       | 項目                                                                                                     | 当最終指定親会<br>社四半期末 | 別紙様式第八号<br>(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                                                               | 7,112            | (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)                                                                                   | 7,112            |                       |
| Tier2資本                             |                                                                                                        |                  |                       |
| 58                                  | Tier2資本の額 ((チ) - (リ)) (ヌ)                                                                              | 2,362            |                       |
| 総自己資本                               |                                                                                                        |                  |                       |
| 59                                  | 総自己資本の額 ((ト) + (ヌ)) (ル)                                                                                | 1,557,238        |                       |
| リスク・アセット (5)                        |                                                                                                        |                  |                       |
| 60                                  | リスク・アセットの額の合計額 (ヲ)                                                                                     | 7,426,777        |                       |
| 連結自己資本規制比率                          |                                                                                                        |                  |                       |
| 61                                  | 連結普通株式等Tier1比率 ((ハ) / (ヲ))                                                                             | 18.41%           |                       |
| 62                                  | 連結Tier1比率 ((ト) / (ヲ))                                                                                  | 20.93%           |                       |
| 63                                  | 連結総自己資本規制比率 ((ル) / (ヲ))                                                                                | 20.96%           |                       |
| 64                                  | 最低連結資本バッファ比率                                                                                           | 3.10%            |                       |
| 65                                  | うち、資本保全バッファ比率                                                                                          | 2.50%            |                       |
| 66                                  | うち、カウンター・シクリカル・バッファ比率                                                                                  | 0.10%            |                       |
| 67                                  | うち、G-SIB/D-SIB バッファ比率                                                                                  | 0.50%            |                       |
| 68                                  | 連結資本バッファ比率                                                                                             | 12.96%           |                       |
| 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                                                                         | 139,298          | (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                                                                 | 100,860          | (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                                                                       | 5,816            | (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。)                                 | —                |                       |

## ■ 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                                                                                        | 1,310,736 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                                                                                        | 39 百万円                | 52 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、最も劣後の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                                                                                        | 67 百万円                | 122 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、最も劣後の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                                                                                        | 173 百万円               | 267 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、最も劣後の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                                                                                        | 336 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、最も劣後の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        | 2016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                                                                                        | 330 百万円               | 348 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             | 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、最も劣後の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12回新株予約権             | 2017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                                                                                        | 194 百万円               | 375 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            | 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、最も劣後の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13回新株予約権             | 2018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                                                                                        | 435 百万円               | 409 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             | 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、最も劣後の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14回新株予約権             | 第15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                                                                                        | 533 百万円               | 369 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8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、最も劣後の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16回新株予約権             | 第17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                                                                                        | 401 百万円               | 474 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)                                                                                           | 2019年8月15日            | 2020年8月17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、最も劣後の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18回新株予約権             | 第19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                                                                                        | 287 百万円               | 432 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)                                                                                           | 2021年8月13日            | 2022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、最も劣後の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            |
| 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                                                                                         | 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                                                                                        | 402 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                 |
| 11  | 発行日 (7)                                                                                           | 2023年8月15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 (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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>30,931百万円<br>Tier2資本に係る基礎項目の額<br>7,278百万円 | その他Tier1資本に係る基礎項目の額<br>9,340百万円<br>Tier2資本に係る基礎項目の額<br>2,197百万円 |
| 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31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<br>(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<br>(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                                                                                        | 124,400 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:<br>年1.20パーセント<br>2025年6月5日の翌日以降:<br>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:<br>年1.39パーセント<br>2030年6月5日の翌日以降:<br>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<br>・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<br>・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<br>・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<br>・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)                                                                                  | —                                                                                                                                             | —                                                                                                                                             |

## ■ 定量的な開示事項

### 1. 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<br>の<br>該当番号 |                                                      | リスク・アセット     |              | 所要自己資本       |              |
|-------------------|------------------------------------------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
|                   |                                                      | 2024年<br>6月末 | 2024年<br>3月末 | 2024年<br>6月末 | 2024年<br>3月末 |
| 1                 | 信用リスク                                                | 2,449,518    | 2,381,958    | 195,961      | 190,556      |
| 2                 | うち、標準的手法適用分                                          | 1,292,144    | 1,230,042    | 103,371      | 98,403       |
| 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                                                  | 1,157,374    | 1,151,915    | 92,589       | 92,153       |
| 4                 | カウンターパーティ信用リスク                                       | 1,616,793    | 1,467,509    | 129,343      | 117,400      |
| 5                 | うち、SA-CCR適用分                                         | 533,198      | 501,306      | 42,655       | 40,104       |
| 6                 | うち、期待エクスポージャー方式適用分                                   | -            | -            | -            | -            |
|                   | うち、CVAリスク                                            | 537,569      | 517,561      | 43,005       | 41,404       |
|                   | うち、中央清算機関関連エクスポージャー                                  | 33,855       | 30,878       | 2,708        | 2,470        |
|                   | その他                                                  | 512,169      | 417,762      | 40,973       | 33,421       |
| 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<br>(レック・スルー方式)      | 314,808      | 305,572      | 25,184       | 24,445       |
| 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<br>(マンドート方式)        | 60,786       | 58,591       | 4,862        | 4,687        |
|                   | 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<br>(蓋然性方式250%)      | 34,692       | -            | 2,775        | -            |
|                   | 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<br>(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<br>(フォールバック方式1250%) | 181          | 161          | 14           | 12           |
| 11                | 未決済取引                                                | 244          | 23           | 19           | 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                   | 243,388      | 218,562      | 19,471       | 17,485       |
| 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                                       | 207,013      | 183,406      | 16,561       | 14,672       |
| 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                                 | 36,375       | 35,156       | 2,910        | 2,812        |
| 16                | マーケット・リスク                                            | 1,256,196    | 1,212,258    | 100,495      | 96,980       |
| 17                | うち、標準的方式適用分                                          | 868,053      | 806,970      | 69,444       | 64,557       |
| 18                | うち、内部モデル方式適用分                                        | 388,142      | 405,288      | 31,051       | 32,423       |
| 19                | オペレーショナル・リスク                                         | 1,183,218    | 1,183,218    | 94,657       | 94,657       |
| 20                | うち、基礎的手法適用分                                          | 1,183,218    | 1,183,218    | 94,657       | 94,657       |
| 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                     | 266,950      | 259,613      | 21,356       | 20,769       |
|                   | 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                                                   | 7,426,777    | 7,087,470    | 594,142      | 566,997      |

【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)

|    | 前四半期末:2024年3月末<br>当四半期末:2024年6月末     | バリュエーション・<br>アット・リスク | ストレステスト・<br>バリュエーション・<br>アット・リスク | 追加的<br>リスク | 包括的<br>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                    | 121,090              | 284,197                          | -          | -          |     | 405,288  |
| 1b | 前四半期末における連結自己資本規制上の<br>リスク・アセット額への調整 | 2.36                 | 3.89                             | -          | -          |     | 3.26     |
| 1c | 前四半期末の算出基準日における内部モ<br>デル方式の算出額       | 51,207               | 73,004                           | -          | -          |     | 124,212  |
| 2  | 当四半期の<br>要因別の<br>変動額                 | リスク量の変動              | ▲ 11,927 ▲ 29,077                | -          | -          |     | ▲ 41,004 |
| 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<br>デル方式の算出額       | 39,280               | 43,927                           | -          | -          |     | 83,208   |
| 8b | 当四半期末における連結自己資本規制上の<br>リスク・アセット額への調整 | 3.78                 | 5.45                             | -          | -          |     | 4.66     |
| 8c | 当四半期末におけるリスク・アセット                    | 148,499              | 239,643                          | -          | -          |     | 388,142  |

## ■ 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<br>(表2)の<br>該当番号            | 国際様式<br>(表1)の<br>該当番号 | 項目                                                    | 2024年6月末   | 2024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                                   | 15,404,033 | 13,213,263 |
| 1a                               | 1                     | 連結貸借対照表における総資産の額                                      | 32,547,626 | 28,483,230 |
| 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。) | 1,312      | 1,347      |
| 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(△)                 | 17,144,905 | 15,271,314 |
| 2                                | 7                     | Tier1 資本に係る調整項目の額(△)                                  | 188,622    | 161,564    |
| 3                                |                       | オン・バランス資産の額 (イ)                                       | 15,215,411 | 13,051,699 |
| 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                          | 991,689    | 907,812    |
| 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                         | 582,439    | 605,842    |
| 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(△)           | 16,484     | 103,733    |
| 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              | 3,464,546  | 3,418,693  |
| 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(△)    | 3,087,317  | 3,020,666  |
| 11                               | 4                     | デリバティブ取引等に関する額 (ロ)                                    | 1,934,873  | 1,807,948  |
| レボ取引等に関する額 (3)                   |                       |                                                       |            |            |
| 12                               |                       | レボ取引等に関する資産の額                                         | 15,307,152 | 13,719,164 |
| 13                               |                       | レボ取引等に関する資産の額から控除した額(△)                               | 4,193,075  | 4,431,088  |
| 14                               |                       | レボ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                     | 253,426    | 196,262    |
| 15                               |                       | 代理取引のエクスポージャーの額                                       |            |            |
| 16                               | 5                     | レボ取引等に関する額 (ハ)                                        | 11,367,503 | 9,484,338  |
| 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                                      | 160,561    | 165,623    |
| 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(△)                     | 55,194     | 47,852     |
| 19                               | 6                     | オフ・バランス取引に関する額 (ニ)                                    | 105,367    | 117,771    |
| 連結レバレッジ比率 (5)                    |                       |                                                       |            |            |
| 20                               |                       | 資本の額 (ホ)                                              | 1,554,875  | 1,520,820  |
| 21                               | 8                     | 総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)                      | 28,623,154 | 24,461,756 |
| 22                               |                       | 連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))                                    | 5.43%      | 6.21%      |
|                                  |                       | 適用する所要連結レバレッジ比率                                       | 3.15%      | 3.00%      |
|                                  |                       | 適用する所要連結レバレッジ・バッファ率                                   | -          | -          |
| 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)                                       | 28,623,154 | 24,461,756 |
|                                  |                       | 日本銀行に対する預け金の額                                         | 3,054,098  | 3,544,069  |
|                                  |                       | 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')                   | 31,677,252 | 28,005,825 |
|                                  |                       | 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'))                | 4.90%      | 5.43%      |

### 2. 前四半期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

当四半期と前四半期の差異の原因は、分母の「総エクスポージャーの額」が 4,161,398 百万円増加したことによるものです。なお、「総エクスポージャーの額」の増加は「オン・バランス資産の額」が 2,163,712 百万円増加したことによるものです。

以 上