

平成 28 年 10 月 28 日

各 位

会社名 株式会社大和証券グループ本社
代表者名 執行役社長 日比野 隆司
(コード番号 8601 東証・名証 (第一部))

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 (平成 28 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
(平成 28 年 6 月末) について下記のとおりお知らせいたします。

記

(単位 百万円)

	平成 28 年 6 月末
1. 連結総自己資本規制比率	22.4 %
2. 連結Tier1 比率	22.2 %
3. 連結普通株式等 Tier1 比率	22.2 %
4. 連結における総自己資本の額	1,119,172
5. 連結におけるTier1 資本の額	1,106,760
6. 連結における普通株式等Tier1 資本の額	1,106,760
7. 連結総所要自己資本額	398,512

8. 自己資本の構成に関する開示事項

(単位 百万円, %)

国際様式の 該当番号	項目	当最終指定親会社 四半期末	経過措置に よる不算入額
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	1,137,854	
1a	うち、資本金及び資本剰余金の額	479,281	
2	うち、利益剰余金の額	688,499	
1c	うち、自己株式の額(△)	29,926	
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	7,957	
3	その他の包括利益累計額及びその他公表準備金の額	22,482	14,988
5	普通株式等Tier1資本に係る調整後非支配株主持分の額	-	
	経過措置により普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額に算入されるものの額の合計額	-	
	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)	1,168,294	
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	50,963	33,975
8	うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	4,398	2,932
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	46,565	31,043
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	258	172
11	繰延ヘッジ損益の額	△217	△145
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	-	-
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	131	87
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	3,389	2,259
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	7,008	
28	普通株式等Tier1資本に係る調整項目の額 (ロ)	61,534	
普通株式等Tier1資本			
29	普通株式等Tier1資本の額 ((イ) - (ロ)) (ハ)	1,106,760	

(単位 百万円, %)

国際様式の 該当番号	項目	当最終指定親会社 四半期末	経過措置に よる不算入額
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	-
		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	-	
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	-	
		-	
	経過措置によりその他Tier1資本に係る基礎項目の額に算入されるものの額の合計額	△3,640	
	外国為替換算調整	△3,640	
36	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 (二)	△3,640	
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	436	290
40	その他金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額	-	-
	経過措置によりその他Tier1資本に係る調整項目の額に算入されるものの額の合計額	2,932	
	のれん	2,932	
42	Tier2資本不足額	-	
43	その他Tier1資本に係る調整項目の額 (ホ)	3,368	
その他Tier1資本			
44	その他Tier1資本の額 ((二) - (ホ)) (ヘ)	-	
Tier1資本			
45	Tier1資本の額 ((ハ) + (ヘ)) (ト)	1,106,760	
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	-	
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	-	
	経過措置によりTier2資本に係る基礎項目の額に算入されるものの額の合計額	15,129	
	その他有価証券評価差額金及び繰延ヘッジ損益	15,129	
51	Tier2資本に係る基礎項目の額 (チ)	15,129	

(単位 百万円, %)

国際様式の 該当番号	項目	当最終指定親会社 四半期末	経過措置に よる不算入額
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資本調達手段の額	-	-
54	少数出資金融機関等のTier2資本調達手段の額	2,718	1,812
55	その他金融機関等のTier2資本調達手段の額	-	-
	経過措置によりTier2資本に係る調整項目の額に算入されるものの額の合計額	-	
57	Tier2資本に係る調整項目の額 (リ)	2,718	
Tier2資本			
58	Tier2資本の額 ((チ) - (リ)) (ヌ)	12,411	
総自己資本			
59	総自己資本の額 ((ト) + (ヌ)) (ル)	1,119,172	
リスク・アセット (5)			
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額の合計額	35,578	
	少数出資金融機関等の資本調達手段	4,362	
	無形固定資産(のれんを除く。)	31,043	
	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)	172	
60	リスク・アセットの額の合計額 (ヲ)	4,981,401	
連結自己資本規制比率			
61	連結普通株式等Tier1比率 ((ハ) / (ヲ))	22.2%	
62	連結Tier1比率 ((ト) / (ヲ))	22.2%	
63	連結総自己資本規制比率 ((ル) / (ヲ))	22.4%	
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調達手段に係る調整項目不算入額	109,805	
73	その他金融機関等に係る対象資本調達手段のうち普通株式に係る調整項目不算入額	29,115	
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	10,156	
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。)	-	

9. 連結自己資本規制比率告示第3条の規定に従い連結財務諸表を作成したと仮定した場合における連結貸借対照表の各科目の額及びこれらの科目が前項に定める自己資本の構成に関する開示項目のいずれに相当するかについての説明

(単位 百万円)

自己資本の構成に関する開示の参照番号		会計上の 連結貸借対照表	告示第3条の規定に基づく 連結貸借対照表
	資産の部		
	流動資産		
	現金・預金	3,533,795	3,533,795
	預託金	282,791	282,791
	受取手形及び売掛金	15,186	15,186
18, 39, 54, 72, 73	有価証券	2,033,230	2,033,230
16, 18, 39, 54, 72, 73	トレーディング商品	9,146,721	9,146,721
18, 39, 54, 72, 73	営業投資有価証券	121,689	121,689
	投資損失引当金	△ 11,030	△ 11,030
	営業貸付金	431,895	431,895
	仕掛品	864	864
	信用取引資産	187,329	187,329
	有価証券担保貸付金	4,575,351	4,575,351
	立替金	23,014	23,014
	短期貸付金	514	514
	未収収益	28,797	28,797
10, 75	繰延税金資産	4,430	4,430
	その他の流動資産	503,894	503,894
	貸倒引当金	△ 689	△ 689
	流動資産計	20,877,787	20,877,787
	固定資産		
	有形固定資産	123,068	123,068
	無形固定資産	84,939	84,939
8	のれん	7,330	7,330
9	のれん以外	77,608	77,608
	投資その他の資産	334,112	334,112
18, 39, 54, 72, 73	投資有価証券	298,444	298,444
10, 75	繰延税金資産	6,157	6,157
	上記以外	29,510	29,510
	固定資産計	542,120	542,120
	資産合計	21,419,907	21,419,907

(単位 百万円)

自己資本の構成に関する開示の参照番号		会計上の 連結貸借対照表	告示第3条の規定に基づく 連結貸借対照表
	負債の部		
	流動負債		
	支払手形及び買掛金	4,634	4,634
	トレーディング商品	5,341,178	5,341,178
	約定見返勘定	1,950,572	1,950,572
	信用取引負債	58,202	58,202
	有価証券担保借入金	5,577,068	5,577,068
	銀行業における預金	2,887,258	2,887,258
	預り金	266,356	266,356
	受入保証金	532,946	532,946
	短期借入金	749,102	749,102
	コマーシャルペーパー	101,850	101,850
	1年内償還予定の社債	209,955	209,955
	未払法人税等	4,931	4,931
	繰延税金負債	2,159	2,159
	賞与引当金	12,314	12,314
	その他の流動負債	164,810	164,810
	固定負債		
	社債	1,220,156	1,220,156
	長期借入金	1,004,862	1,004,862
	繰延税金負債	13,186	13,186
	退職給付に係る負債	38,900	38,900
	訴訟損失引当金	1,975	1,975
	その他の固定負債	6,210	6,210
	特別法上の準備金	3,970	3,970
	負債合計	20,152,603	20,152,603
	純資産の部		
	株主資本		
1a	資本金	247,397	247,397
1a	資本剰余金	231,884	231,884
2	利益剰余金	688,499	688,499
1c	自己株式	△ 29,926	△ 29,926
1c	自己株式申込証拠金	-	-
	株主資本合計	1,137,854	1,137,854
	その他の包括利益累計額		
	その他有価証券評価差額金	83,290	83,290
11	繰延ヘッジ損益	△ 36,718	△ 36,718
	為替換算調整勘定	△ 9,100	△ 9,100
3	その他の包括利益累計額	37,471	37,471
1b	新株予約権	7,957	7,957
34-35, 48-49	非支配株主持分	84,020	84,020
	純資産合計	1,267,304	1,267,304

10. 自己資本調達手段に関する契約内容の概要

1	発行者	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無
3	準拠法	国内法
	規制上の取り扱い	
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	普通株式
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額	
	連結自己資本規制比率	1,137,854百万円
9	額面総額	—
10	表示される科目の区分	
	連結貸借対照表	株主資本
11	発行日	—
12	償還期限の有無	無
13	その日付	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	—
	剰余金の配当又は利息の支払	
17	配当率又は利率の種類	変動
18	配当率又は利率	—
19	配当等停止条項の有無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無
24	転換が生じる場合	—
25	転換の範囲	—
26	転換の比率	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—
30	元本の削減に係る特約の有無	無
31	元本の削減が生じる場合	—
32	元本の削減が生じる範囲	—
33	元本回復特約の有無	—
34	その概要	—
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無
37	非充足資本要件の内容	—

1	発行者	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無
3	準拠法	国内法
	規制上の取り扱い	
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2006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	
	連結自己資本規制比率	231百万円
9	額面総額	—
10	表示される科目の区分	
	連結貸借対照表	新株予約権
11	発行日	2006年7月1日
12	償還期限の有無	有
13	その日付	2026年6月30日
14	償還等を可能とする特約の有無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	—
	剰余金の配当又は利息の支払	
17	配当率又は利率の種類別	変動
18	配当率又は利率	—
19	配当等停止条項の有無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無
24	転換が生じる場合	—
25	転換の範囲	—
26	転換の比率	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—
30	元本の削減に係る特約の有無	無
31	元本の削減が生じる場合	—
32	元本の削減が生じる範囲	—
33	元本回復特約の有無	—
34	その概要	—
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無
37	非充足資本要件の内容	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2007年7月発行新株予約権	第4回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	254百万円	811百万円
9	額面総額	—	—
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2007年7月1日	2007年9月3日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2027年6月30日	2017年6月22日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別	変動	変動
18	配当率又は利率	—	—
19	配当等停止条項の有無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合	—	—
25	転換の範囲	—	—
26	転換の比率	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無	無	無
31	元本の削減が生じる場合	—	—
32	元本の削減が生じる範囲	—	—
33	元本回復特約の有無	—	—
34	その概要	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十一日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2008年7月発行新株予約権	第5回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	238百万円	637百万円
9	額面総額	—	—
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2008年7月1日	2008年9月8日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2028年6月30日	2018年6月20日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別	変動	変動
18	配当率又は利率	—	—
19	配当等停止条項の有無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合	—	—
25	転換の範囲	—	—
26	転換の比率	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無	無	無
31	元本の削減が生じる場合	—	—
32	元本の削減が生じる範囲	—	—
33	元本回復特約の有無	—	—
34	その概要	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2009年7月発行新株予約権	第6回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	313百万円	319百万円
9	額面総額	—	—
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2009年7月1日	2009年11月9日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2029年6月30日	2019年6月19日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別	変動	変動
18	配当率又は利率	—	—
19	配当等停止条項の有無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合	—	—
25	転換の範囲	—	—
26	転換の比率	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無	無	無
31	元本の削減が生じる場合	—	—
32	元本の削減が生じる範囲	—	—
33	元本回復特約の有無	—	—
34	その概要	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十一日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2010年7月発行新株予約権	第7回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	355百万円	333百万円
9	額面総額	—	—
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2010年7月1日	2010年9月1日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2030年6月30日	2020年6月25日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別	変動	変動
18	配当率又は利率	—	—
19	配当等停止条項の有無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合	—	—
25	転換の範囲	—	—
26	転換の比率	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無	無	無
31	元本の削減が生じる場合	—	—
32	元本の削減が生じる範囲	—	—
33	元本回復特約の有無	—	—
34	その概要	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2011年7月発行新株予約権	第8回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	413百万円	483百万円
9	額面総額	—	—
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2011年7月1日	2011年9月5日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2031年6月30日	2021年6月24日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別	変動	変動
18	配当率又は利率	—	—
19	配当等停止条項の有無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合	—	—
25	転換の範囲	—	—
26	転換の比率	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無	無	無
31	元本の削減が生じる場合	—	—
32	元本の削減が生じる範囲	—	—
33	元本回復特約の有無	—	—
34	その概要	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十一日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2013年2月発行新株予約権	第9回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	453百万円	947百万円
9	額面総額	—	—
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2013年2月12日	2013年2月12日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2032年6月30日	2022年6月26日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別	変動	変動
18	配当率又は利率	—	—
19	配当等停止条項の有無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合	—	—
25	転換の範囲	—	—
26	転換の比率	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無	無	無
31	元本の削減が生じる場合	—	—
32	元本の削減が生じる範囲	—	—
33	元本回復特約の有無	—	—
34	その概要	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十一日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2014年2月発行新株予約権	第10回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	372百万円	640百万円
9	額面総額	—	—
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2014年2月10日	2014年2月10日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2033年6月30日	2023年6月25日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別	変動	変動
18	配当率又は利率	—	—
19	配当等停止条項の有無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合	—	—
25	転換の範囲	—	—
26	転換の比率	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無	無	無
31	元本の削減が生じる場合	—	—
32	元本の削減が生じる範囲	—	—
33	元本回復特約の有無	—	—
34	その概要	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十一日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2015年2月発行新株予約権	第11回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	389百万円	328百万円
9	額面総額	—	—
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2015年2月9日	2015年2月9日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2034年6月30日	2024年6月25日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別	変動	変動
18	配当率又は利率	—	—
19	配当等停止条項の有無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合	—	—
25	転換の範囲	—	—
26	転換の比率	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無	無	無
31	元本の削減が生じる場合	—	—
32	元本の削減が生じる範囲	—	—
33	元本回復特約の有無	—	—
34	その概要	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2016年2月発行新株予約権	第12回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	385百万円	48百万円
9	額面総額	—	—
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2016年2月8日	2016年2月8日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2035年6月30日	2025年6月24日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別	変動	変動
18	配当率又は利率	—	—
19	配当等停止条項の有無	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合	—	—
25	転換の範囲	—	—
26	転換の比率	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無	無	無
31	元本の削減が生じる場合	—	—
32	元本の削減が生じる範囲	—	—
33	元本回復特約の有無	—	—
34	その概要	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	—	—

11. 自己資本調達手段に関する契約内容の詳細

当社グループにおける自己資本調達手段は全て普通株式等のため契約内容の概要と同様の内容です。

12. 連結レバレッジ比率の構成に関する開示事項

(単位 百万円, %)

国際様式 (表2)の 該当番号	国際様式 (表1)の 該当番号	項目	平成28年6月末	平成28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	12,318,006	11,191,385
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	21,419,907	20,420,818
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(△)	0	0
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。)	0	0
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(△)	9,101,901	9,229,433
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(△)	64,902	64,848
3		オン・バランス資産の額 (イ)	12,253,104	11,126,537
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再構築コストの額	614,211	656,938
5		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	1,160,338	1,144,044
		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた証拠金の対価の額	336,539	279,118
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現金で差し入れた証拠金の対価の額	0	0
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(△)	206,495	149,476
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	1,871,956	2,200,308
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(△)	1,425,735	1,753,296
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	2,350,814	2,377,636
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	5,811,584	6,531,364
13		レボ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	1,354,168	1,569,600
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	149,350	140,262
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)	4,606,766	5,102,026
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	55,238	56,650
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(△)	11,108	8,499
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	44,130	48,151
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	1,106,760	1,117,436
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	19,254,814	18,654,350
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	5.74%	5.99%

13. 前最終指定親会社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

前最終指定親会社四半期の連結レバレッジ比率との間に著しい差異はございません。

以上

<お問い合わせ先>

大和証券グループ本社 広報部 鈴木・青山・木下・大橋・桑原 (Tel. 03-5555-1165)