

平成 30 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 執行役社長 中田 誠司
(コード番号 8601 東証・名証 (第 1 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 30 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 30 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
■	定性的な開示事項.....	7
1.	連結貸借対照表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かに相当する かについての説明.....	7
■	自己資本調達手段に関する契約内容の概要.....	9
■	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】

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号		平成30年 6月末	平成30年 3月末	平成29年 12月末	平成29年 9月末	平成29年 6月末
資本						
1	普通株式等Tier1 資本の額	1,134,950	1,142,340	1,142,707	1,134,487	1,140,227
2	Tier1資本の額	1,134,950	1,142,340	1,142,707	1,134,487	1,140,227
3	総自己資本の額	1,134,950	1,142,340	1,142,707	1,134,487	1,140,227
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	4,989,109	5,125,879	5,257,936	5,106,753	5,043,690
自己資本比率						
5	連結普通株式等 Tier1比率	22.74%	22.28%	21.73%	22.21%	22.60%
6	連結Tier1比率	22.74%	22.28%	21.73%	22.21%	22.60%
7	連結総自己資本 比率	22.74%	22.28%	21.73%	22.21%	22.60%
資本バッファー						
8	資本保全バッファー 比率	1.87%	1.87%	1.25%	1.25%	1.25%
9	カウンター・シクリカル ・バッファー比率	0.01%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
10	G-SIB/D-SIBバッ ファー比率	0.37%	0.37%	0.25%	0.25%	0.25%
11	最低連結資本バッ ファー比率	2.26%	2.25%	1.50%	1.50%	1.50%
12	連結資本バッファー 比率	14.74%	14.28%	13.73%	14.21%	14.60%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャー の額	19,902,398	20,358,038	20,987,142	19,524,574	18,979,308
14	連結レバレッジ比率	5.70%	5.61%	5.44%	5.81%	6.00%

■ 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
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	1,203,899
1a	うち、資本金及び資本剰余金の額	478,111
2	うち、利益剰余金の額	779,965
1c	うち、自己株式の額(△)	54,176
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	8,286
3	その他の包括利益累計額及びその他公表準備金の額	70,557
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)	1,282,744
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	107,752
8	うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	10,977
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	96,775
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	362
11	繰延ヘッジ損益の額	▲ 103
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	326
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	16,913
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	22,543
28	普通株式等Tier1資本に係る調整項目の額 (ロ)	147,794
普通株式等Tier1資本		
29	普通株式等Tier1資本の額 ((イ) - (ロ)) (ハ)	1,134,950

(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	
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	-
36		その他Tier1資本に係る基礎項目の額 (二)	-
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	3,653
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	18,889
43		その他Tier1資本に係る調整項目の額 (ホ)	22,543
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)	1,134,950
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	-
51		Tier2資本に係る基礎項目の額 (チ)	-

(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
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	18,889
55	その他金融機関等のTier2資本調達手段の額	-
57	Tier2資本に係る調整項目の額 (リ)	18,889
Tier2資本		
58	Tier2資本の額 ((チ) - (リ)) (ヌ)	-
総自己資本		
59	総自己資本の額 ((ト) + (ヌ)) (ル)	1,134,950
リスク・アセット (5)		
60	リスク・アセットの額の合計額 (ヲ)	4,989,109
連結自己資本規制比率		
61	連結普通株式等Tier1比率 ((ハ) / (ヲ))	22.74%
62	連結Tier1比率 ((ト) / (ヲ))	22.74%
63	連結総自己資本規制比率 ((ル) / (ヲ))	22.74%
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	117,440
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	36,826
74	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライセンスに係るものに限る。)に係る調整項目不算入額	-
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	4,559
Tier2資本に係る基礎項目の額に算入される引当金に関する事項 (7)		
76	一般貸倒引当金の額	-
77	一般貸倒引当金に係るTier2資本算入上限額	-
78	内部格付手法採用最終指定親会社において、適格引当金の合計額から事業法人等向けエクスポージャー及びリテール向けエクスポージャーの期待損失額の合計額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-
79	適格引当金に係るTier2資本算入上限額	-
資本調達手段に係る経過措置に関する事項 (8)		
82	適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額	-
83	適格旧Tier1資本調達手段の額から適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-
84	適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額	-
85	適格旧Tier2資本調達手段の額から適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-

■ 定性的な開示事項

1. 連結貸借対照表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か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	4,124,838	4,124,838
	預託金	329,698	329,698
	受取手形及び売掛金	18,200	18,200
18, 39, 54, 72, 73	有価証券	1,072,150	1,072,150
16, 18, 39, 54, 72, 73	トレーディング商品	7,404,147	7,404,147
	約定見返勘定	-	-
18, 39, 54, 72, 73	営業投資有価証券	104,613	104,613
	投資損失引当金	▲ 472	▲ 472
	営業貸付金	1,606,169	1,606,169
	仕掛品	1,145	1,145
	信用取引資産	240,099	240,099
	有価証券担保貸付金	4,765,672	4,765,672
	立替金	43,470	43,470
	短期貸付金	1,127	1,127
	未収収益	41,481	41,481
10, 75	繰延税金資産	-	-
	その他の流動資産	406,417	406,417
	貸倒引当金	▲ 246	▲ 246
	流動資産計	20,158,513	20,158,513
	固定資産		
	有形固定資産	147,335	147,335
	無形固定資産	107,752	107,752
8	のれん	10,977	10,977
9	のれん以外	96,775	96,775
	投資その他の資産	440,249	440,249
18, 39, 54, 72, 73	投資有価証券	380,724	380,724
10, 75	繰延税金資産	4,921	4,921
	上記以外	54,603	54,603
	固定資産計	695,338	695,338
	繰延資産計	-	-
	資産合計	20,853,852	20,853,852

(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	5,437	5,437
	トレーディング商品	4,754,866	4,754,866
	約定見返勘定	478,964	478,964
	信用取引負債	70,677	70,677
	有価証券担保借入金	5,316,158	5,316,158
	銀行業における預金	3,536,229	3,536,229
	預り金	338,002	338,002
	受入保証金	388,122	388,122
	短期借入金	1,234,195	1,234,195
	コマーシャルペーパー	150,000	150,000
	1年内償還予定の社債	228,870	228,870
	未払法人税等	3,074	3,074
	繰延税金負債	-	-
	賞与引当金	11,882	11,882
	その他の流動負債	115,530	115,530
	固定負債		
	社債	1,327,988	1,327,988
	長期借入金	1,428,330	1,428,330
	繰延税金負債	15,272	15,272
	退職給付に係る負債	42,262	42,262
	訴訟損失引当金	25,098	25,098
	負ののれん	-	-
	その他の固定負債	7,696	7,696
	特別法上の準備金	3,945	3,945
	負債合計	19,482,607	19,482,607
	純資産の部		
	株主資本		
1a	資本金	247,397	247,397
1a	資本剰余金	230,713	230,713
2	利益剰余金	779,965	779,965
1c	自己株式	▲ 54,223	▲ 54,223
1c	自己株式申込証拠金	46	46
	株主資本合計	1,203,899	1,203,899
	その他の包括利益累計額		
	その他有価証券評価差額金	64,908	64,908
11	繰延ヘッジ損益	551	551
	為替換算調整勘定	5,097	5,097
3	その他の包括利益累計額	70,557	70,557
1b	新株予約権	8,286	8,286
34-35, 48-49	非支配株主持分	88,500	88,500
	純資産合計	1,371,244	1,371,244

■ 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	1,203,899 百万円
9	額面総額	—
10	表示される科目の区分	
	連結貸借対照表	株主資本
11	発行日	—
12	償還期限の有無	無
13	その日付	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	—
	剰余金の配当又は利息の支払	
17	配当率又は利率の種別	変動
18	配当率又は利率	—
19	配当等停止条項の有無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無
24	転換が生じる場合	—
25	転換の範囲	—
26	転換の比率	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—
30	元本の削減に係る特約の有無	無
31	元本の削減が生じる場合	—
32	元本の削減が生じる範囲	—
33	元本回復特約の有無	—
34	その概要	—
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無
37	非充足資本要件の内容	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2006年7月発行新株予約権	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		
	連結自己資本規制比率	171百万円	217百万円
9	額面総額	—	—
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2006年7月1日	2007年7月1日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2026年6月30日	2027年6月30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	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		
	連結自己資本規制比率	204 百万円	273 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	2009年7月1日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2028年6月30日	2029年6月30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	第6回新株予約権	2010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	246 百万円	321 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11月9日	2010年7月1日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2019年6月19日	2030年6月30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	第7回新株予約権	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		
	連結自己資本規制比率	239 百万円	385 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9月1日	2011年7月1日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2020年6月25日	2031年6月30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	第8回新株予約権	2013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		
	連結自己資本規制比率	241 百万円	442 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9月5日	2013年2月12日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2021年6月24日	2032年6月30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	第9回新株予約権	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		
	連結自己資本規制比率	996 百万円	368 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	2014年2月10日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2022年6月26日	2033年6月30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	第10回新株予約権	2015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		
	連結自己資本規制比率	1,157 百万円	384 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	2015年2月9日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2023年6月25日	2034年6月30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	第11回新株予約権	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		
	連結自己資本規制比率	780百万円	383百万円
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	2016年2月16日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2024年6月25日	2035年6月30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	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		
	連結自己資本規制比率	270百万円	404百万円
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16日	2017年2月8日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2025年6月24日	2036年6月30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	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		
	連結自己資本規制比率	278 百万円	435 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	2017年2月8日	2018年2月8日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2026年6月27日	2037年6月30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
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	第14回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額	
	連結自己資本規制比率	82 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	2018年2月8日
12	償還期限の有無	有
13	その日付	2027年6月27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	—

■ 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)

国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		当四半期末	前四半期末	当四半期末	前四半期末
1	信用リスク	903,494	903,175	72,279	72,254
2	うち、標準的手法適用分	722,141	747,448	57,771	59,795
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	181,353	155,726	14,508	12,458
4	カウンターパーティ信用リスク	1,186,894	1,261,575	94,951	100,926
5	うち、SA-CCR適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	320,406	330,889	25,632	26,471
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	547,697	564,809	43,815	45,184
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	27,670	27,929	2,213	2,234
	その他	291,119	337,948	23,289	27,035
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	-	-	-	-
	複数の資産及び取引を裏付けとするエクスポージャー	316,514	301,418	25,321	24,113
	信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャー	-	-	-	-
11	未決済取引	490	391	39	31
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	149,212	138,181	11,936	11,054
13	うち、内部格付手法における外部格付準拠方式又は 内部評価方式適用分	-	-	-	-
14	うち、内部格付手法における指定関数方式適用分	-	-	-	-
15	うち、標準的手法適用分	149,212	138,181	11,936	11,054
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	1,418,973	1,461,548	113,517	116,923
17	うち、標準的方式適用分	903,919	860,281	72,313	68,822
18	うち、内部モデル方式適用分	515,053	601,266	41,204	48,101
19	オペレーショナル・リスク	1,002,132	1,028,878	80,170	82,310
20	うち、基礎的手法適用分	1,002,132	1,028,878	80,170	82,310
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	11,397	30,709	911	2,456
	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	4,989,109	5,125,879	399,128	410,070

【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)

		バリュエーション・アット・リスク	ストレス・バリュエーション・アット・リスク	追加的リスク	包括的リスク	その他	合計
1a	前四半期末におけるリスク・アセット	189,559	411,707	-	-		601,266
1b	前四半期末における連結自己資本規制上のリスク・アセット額への調整	6	4	-	-		4
1c	前四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	32,178	106,780	-	-		138,959
2	当四半期の要因別の変動額	リスク量の変動	▲ 7,474	▲ 46,326	-	-	▲ 53,801
3		モデルの更新又は変更	-	-	-	-	-
4		手法及び方針	-	-	-	-	-
5		買収及び売却	-	-	-	-	-
6		為替の変動	-	-	-	-	-
7		その他	-	-	-	-	-
8a		当四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	24,703	60,454	-	-	
8b	当四半期末における連結自己資本規制上のリスク・アセット額への調整	7	6	-	-		6
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	176,889	338,164	-	-		515,053

■ 連結レバレッジ比率に関する開示事項

1. 連結レバレッジ比率の構成に関する開示

(単位 百万円 %)

国際様式 (表2)の 該当番号	国際様式 (表1)の 該当番号	項目	平成30年6月末	平成30年3月末
オン・バランス資産の額 (1)				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	13,000,620	11,659,677
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	20,853,852	21,141,743
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。)	-	-
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(△)	7,853,232	9,482,066
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(△)	147,794	115,303
3		オン・バランス資産の額 (イ)	12,852,826	11,544,374
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	406,806	432,448
5		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	1,302,834	1,310,291
		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	263,352	264,892
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	-	-
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(△)	88,903	118,441
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	1,201,463	1,551,276
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(△)	929,108	1,253,152
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	2,156,444	2,187,314
レポ取引等に関する額 (3)				
12		レポ取引等に関する資産の額	5,997,069	7,517,198
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	1,323,443	1,156,495
14		レポ取引等に関するカウンターパーティ・リスクのエクスポージャーの額	169,138	211,873
15		代理取引のエクスポージャーの額		
16	5	レポ取引等に関する額 (ハ)	4,842,764	6,572,576
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	82,287	80,259
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(△)	31,923	26,485
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	50,364	53,774
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	1,134,950	1,142,340
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	19,902,398	20,358,038
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	5.70%	5.61%

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連結レバレッジ比率の差異はありません。

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・大橋・桑原・上岡・橋本 (Tel.03-5555-1165)