

2019年1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 (2018年9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
(2018年9月末) について下記のとおりお知らせいたします。

記

<お問い合わせ先>

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

目次

■	主要な指標.....	3
■	自己資本の構成に関する開示事項.....	4
■	定性的な開示事項.....	7
1.	連結の範囲に関する事項.....	7
2.	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.....	9
■	定量的な開示事項.....	11
1.	その他金融機関等であって最終指定親会社の子法人等であるもののうち、連結自己資本規制比率規制上の所要自己資本を下回った会社の名称及び所要自己資本を下回った額の総額.....	11
2.	複数の資産及び取引を裏付とするエクスポージャーで、リスク・ウェイトを直接に判定することができないものの額.....	11
3.	その他定量的な開示事項.....	12
■	連結レバレッジ比率に関する開示事項.....	31
1.	連結レバレッジ比率の構成に関する開示.....	31
2.	前中間事業年度の連結レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた原因.....	31
■	自己資本調達手段に関する契約内容の概要.....	32

■ 主要な指標

【KM1】

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号		2018年 9月末	2018年 6月末	2018年 3月末	2017年 12月末	2017年 9月末
資本						
1	普通株式等Tier1 資本の額	1,111,476	1,134,950	1,142,340	1,142,707	1,134,487
2	Tier1資本の額	1,111,476	1,134,950	1,142,340	1,142,707	1,134,487
3	総自己資本の額	1,111,476	1,134,950	1,142,340	1,142,707	1,134,487
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	5,234,732	4,989,109	5,125,879	5,257,936	5,106,753
自己資本比率						
5	連結普通株式等 Tier1比率	21.23%	22.74%	22.28%	21.73%	22.21%
6	連結Tier1比率	21.23%	22.74%	22.28%	21.73%	22.21%
7	連結総自己資本 比率	21.23%	22.74%	22.28%	21.73%	22.21%
資本バッファー						
8	資本保全バッファー 比率	1.87%	1.87%	1.87%	1.25%	1.25%
9	カウンター・シクリカ ル・バッファー比率	0.01%	0.01%	0.00%	0.00%	0.00%
10	G-SIB/D-SIBバッ ファー比率	0.37%	0.37%	0.37%	0.25%	0.25%
11	最低連結資本バッ ファー比率	2.26%	2.26%	2.25%	1.50%	1.50%
12	連結資本バッファー 比率	13.23%	14.74%	14.28%	13.73%	14.21%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャー の額	19,458,472	19,902,398	20,358,038	20,987,142	19,524,574
14	連結レバレッジ比率	5.71%	5.70%	5.61%	5.44%	5.81%

■ 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	2018年9月末
		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	1,194,962
1a	うち、資本金及び資本剰余金の額	478,030
2	うち、利益剰余金の額	797,625
1c	うち、自己株式の額(△)	61,397
26	うち、社外流出予定額(△)	19,295
	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	8,445
3	その他の包括利益累計額及びその他公表準備金の額	75,097
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)	1,278,505
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	110,803
8	うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	10,740
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	100,063
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	347
11	繰延ヘッジ損益の額	▲ 67
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	390
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	24,703
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	30,850
28	普通株式等Tier1資本に係る調整項目の額 (ロ)	167,029
普通株式等Tier1資本		
29	普通株式等Tier1資本の額 ((イ) - (ロ)) (ハ)	1,111,476

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目	2018年9月末	
		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	7,637	
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	23,213	
43	その他Tier1資本に係る調整項目の額	(ホ)	30,850
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)	1,111,476
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	2018年9月末	
		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		23,213
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)		23,213
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)		1,111,476
リスク・アセット (5)			
60	リスク・アセットの額の合計額 (ヲ)		5,234,732
連結自己資本規制比率			
61	連結普通株式等Tier1比率 ((ハ) / (ヲ))		21.23%
62	連結Tier1比率 ((ト) / (ヲ))		21.23%
63	連結総自己資本規制比率 ((ル) / (ヲ))		21.23%
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		116,702
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		42,609
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		5,868
Tier2資本に係る基礎項目の額に算入される引当金に関する事項 (7)			
76	一般貸倒引当金の額		-
77	一般貸倒引当金に係るTier2資本算入上限額		-
78	内部格付手法採用最終指定親会社において、適格引当金の合計額から事業法人等向けエクスポージャー及びリテール向けエクスポージャーの期待損失額の合計額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)		-
79	適格引当金に係るTier2資本算入上限額		-
資本調達手段に係る経過措置に関する事項 (8)			
82	適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額		-
83	適格旧Tier1資本調達手段の額から適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)		-
84	適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額		-
85	適格旧Tier2資本調達手段の額から適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)		-

■ 定性的な開示事項

1. 連結の範囲に関する事項

イ) 連結自己資本規制比率告示第 3 条の規定により連結自己資本規制比率を算出する対象となる会社の集団（会社グループ）に属する会社と連結財務諸表提出会社として作成された連結財務諸表における連結の範囲（会計連結範囲）に含まれる会社との相違点及び当該相違点の生じた原因

相違点はありません。

ロ) 会社グループのうち、連結子会社の数並びに主要な連結子会社の名称及び主要な業務の内容

連結子会社の数

60 社

主要な連結子会社の名称	主要な業務の内容
大和証券株式会社	有価証券関連業、投資助言・代理業
大和証券投資信託委託株式会社	投資運用業、投資助言・代理業
株式会社大和総研ホールディングス	子会社の統合・管理
株式会社大和証券ビジネスセンター	事務代行業
大和プロパティ株式会社	不動産賃貸業
株式会社大和ネクスト銀行	銀行業
株式会社大和総研	情報サービス業
株式会社大和総研ビジネス・イノベーション	情報サービス業
株式会社大和キャピタル・ホールディングス	子会社の統合・管理
大和企業投資株式会社	投資業
大和PIパートナーズ株式会社	投資業
大和リアル・エステート・アセット・マネジメント株式会社	投資運用業、投資助言・代理業
大和証券キャピタル・マーケットズヨーロッパリミテッド	有価証券関連業
大和証券キャピタル・マーケットズ香港リミテッド	有価証券関連業
大和証券キャピタル・マーケットズシンガポールリミテッド	有価証券関連業
大和証券キャピタル・マーケットズアメリカホールディングスInc.	子会社の統合・管理
大和証券キャピタル・マーケットズアメリカInc.	有価証券関連業

ハ) 連結自己資本規制比率告示第 9 条の規定が適用される金融業務を営む関連会社等の数、名称、貸借対照表の総資産の額及び純資産の額並びに主要な業務の内容

比例連結の方法を適用している金融業務を営む関連法人等はありません。

ニ)会社グループに属する会社であって会計連結範囲に含まれないもの及び会社グループに属しない会社であって会計連結範囲に含まれるものの名称、貸借対照表の総資産の額及び純資産の額並びに主要な業務の内容

該当ありません。

ホ)会社グループ内の資金及び自己資本の移動に係る制限等の概要

グループ内の資金及び自己資本の移動に係る特別な制限等はありません。

2. 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	3,580,301	3,580,301
	預託金	341,878	341,878
	受取手形及び売掛金	18,338	18,338
18, 39, 54, 72, 73	有価証券	1,040,638	1,040,638
16, 18, 39, 54, 72, 73	トレーディング商品	6,558,521	6,558,521
	約定見返勘定	-	-
18, 39, 54, 72, 73	営業投資有価証券	104,809	104,809
	投資損失引当金	▲ 469	▲ 469
	営業貸付金	1,537,081	1,537,081
	仕掛品	1,205	1,205
	信用取引資産	210,820	210,820
	有価証券担保貸付金	6,295,319	6,295,319
	立替金	28,572	28,572
	短期貸付金	390	390
	未収収益	39,867	39,867
10, 75	繰延税金資産	-	-
	その他の流動資産	501,489	501,489
	貸倒引当金	▲ 246	▲ 246
	流動資産計	20,258,518	20,258,518
	固定資産		
	有形固定資産	147,656	147,656
	無形固定資産	110,803	110,803
8	のれん	10,740	10,740
9	のれん以外	100,063	100,063
	投資その他の資産	446,540	446,540
18, 39, 54, 72, 73	投資有価証券	384,689	384,689
10, 75	繰延税金資産	6,215	6,215
	上記以外	55,634	55,634
	固定資産計	705,000	705,000
	繰延資産計	-	-
	資産合計	20,963,519	20,963,519

(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	6,913	6,913
	トレーディング商品	4,714,524	4,714,524
	約定見返勘定	418,396	418,396
	信用取引負債	73,092	73,092
	有価証券担保借入金	6,129,329	6,129,329
	銀行業における預金	3,617,462	3,617,462
	預り金	326,613	326,613
	受入保証金	396,911	396,911
	短期借入金	493,887	493,887
	コマーシャルペーパー	150,000	150,000
	1年内償還予定の社債	200,124	200,124
	未払法人税等	7,510	7,510
	繰延税金負債	-	-
	賞与引当金	21,401	21,401
	その他の流動負債	105,582	105,582
	固定負債		
	社債	1,358,839	1,358,839
	長期借入金	1,550,609	1,550,609
	繰延税金負債	11,571	11,571
	退職給付に係る負債	42,708	42,708
	訴訟損失引当金	25,898	25,898
	負ののれん	-	-
	その他の固定負債	7,213	7,213
	特別法上の準備金	3,945	3,945
	負債合計	19,662,535	19,662,535
	純資産の部		
	株主資本		
1a	資本金	247,397	247,397
1a	資本剰余金	230,633	230,633
2	利益剰余金	797,625	797,625
1c	自己株式	▲ 61,413	▲ 61,413
1c	自己株式申込証拠金	16	16
	株主資本合計	1,214,258	1,214,258
	その他の包括利益累計額		
	その他有価証券評価差額金	59,956	59,956
11	繰延ヘッジ損益	2,334	2,334
	為替換算調整勘定	12,806	12,806
3	その他の包括利益累計額	75,097	75,097
1b	新株予約権	8,445	8,445
34-35, 48-49	非支配株主持分	3,183	3,183
	純資産合計	1,300,984	1,300,984

■ 定量的な開示事項

1. その他金融機関等であって最終指定親会社の子法人等であるもののうち、連結自己資本規制比率規制上の所要自己資本を下回った会社の名称及び所要自己資本を下回った額の総額

該当ありません。

2. 複数の資産及び取引を裏付とするエクスポージャーで、リスク・ウェイトを直接に判定することができないものの額

(単位 百万円)

	エクスポージャーの額
合計	746,603

3. 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	
		2018年 9月末	2017年 9月末	2018年 9月末	2017年 9月末
1	信用リスク	884,040		70,723	
2	うち、標準的手法適用分	703,163		56,253	
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	180,877		14,470	
4	カウンターパーティ信用リスク	1,244,837		99,587	
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	316,493		25,319	
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-		-	
	うち、CVAリスク	537,603		43,008	
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	32,038		2,563	
	その他	358,702		28,696	
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	394,470		31,557	
	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	165		13	
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	148,437		11,875	
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	148,437		11,875	
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-		-	
16	マーケット・リスク	1,555,923		124,473	
17	うち、標準的方式適用分	940,241		75,219	
18	うち、内部モデル方式適用分	615,682		49,254	
19	オペレーショナル・リスク	992,187		79,375	
20	うち、基礎的手法適用分	992,187		79,375	
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	14,670		1,173	
	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	5,234,732		418,778	

(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	
		2018年 9月末	2018年 6月末	2018年 9月末	2018年 6月末
1	信用リスク	884,040	903,494	70,723	72,279
2	うち、標準的手法適用分	703,163	722,141	56,253	57,771
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	180,877	181,353	14,470	14,508
4	カウンターパーティ信用リスク	1,244,837	1,186,894	99,587	94,951
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	316,493	320,406	25,319	25,632
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	537,603	547,697	43,008	43,815
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	32,038	27,670	2,563	2,213
	その他	358,702	291,119	28,696	23,289
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	394,470	316,514	31,557	25,321
	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	165	490	13	39
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	148,437	149,212	11,875	11,936
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	148,437	149,212	11,875	11,936
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	1,555,923	1,418,973	124,473	113,517
17	うち、標準的方式適用分	940,241	903,919	75,219	72,313
18	うち、内部モデル方式適用分	615,682	515,053	49,254	41,204
19	オペレーショナル・リスク	992,187	1,002,132	79,375	80,170
20	うち、基礎的手法適用分	992,187	1,002,132	79,375	80,170
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	14,670	11,397	1,173	911
	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	5,234,732	4,989,109	418,778	399,128

【CR1】資産の信用の質

(単位 百万円)

	帳簿価額の総額		引当金	ネット金額	
	デフォルトした エクスポージャー	非 デフォルト エクスポージャー			
オン・バランスシートの資産					
1	貸出金	-	831,173	49	831,123
2	有価証券(うち負債性のもの)	-	772,405	-	772,405
3	その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)	559	3,690,490	1,748	3,689,301
4	オン・バランスシートの資産の合計(1+2+3)	559	5,294,069	1,798	5,292,830
オフ・バランスシートの資産					
5	支払承諾等	-	1,858	-	1,858
6	コミットメント等	-	19,010	-	19,010
7	オフ・バランスシートの資産の合計(5+6)	-	20,868	-	20,868
合計					
8	合計(4+7)	559	5,314,937	1,807	5,313,690

(注)「ネット金額」の項目では、「デフォルトしたエクスポージャー」と「非デフォルトエクスポージャー」の合計額から「引当金」を差し引いた値を記載しております。

【CR2】デフォルトした貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の残高の変動

(単位 百万円)

	前事業年度末:2018年3月末 当中間期末:2018年9月末	額	
1	前事業年度末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の残高	475	
2	貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の当中間 期中の要因別の変動額	デフォルトした額	61
3		非デフォルト状態へ復帰した額	6
4		償却された額	-
5		その他の変動額	29
6	当中間期末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の残高(1+2-3-4+5)	559	

(注)「その他の変動額」に記載の変動額のうち、主な発生要因としては為替の変動が挙げられます。

【CR3】信用リスク削減手法

(単位 百万円)

	非保全 エクスポージャー	保全された エクスポージャー	担保で保全 された エクスポージャー	保証で保全 された エクスポージャー	クレジット・ デリバティブ で保全 された エクスポージャー
1	貸出金	773,005	58,118	58,118	-
2	有価証券(負債性のもの)	772,405	-	-	-
3	その他オン・バランスシートの資産(負債性のもの)	3,689,301	-	-	-
4	合計(1+2+3)	5,234,712	58,118	58,118	-
5	うちデフォルトしたもの	559	-	-	-

【CR4】標準的手法-信用リスク・エクスポージャーと信用リスク削減手法の効果

(単位 百万円、%)

	資産クラス	CCF・信用リスク削減手法適用前のエクスポージャー		CCF・信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー		信用リスク・アセットの額	リスク・ウェイトの加重平均値(RWA density)
		オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額	オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額		
1	現金	-	-	-	-	-	-
2	日本国政府及び日本銀行向け	3,873,651	-	3,873,651	-	-	-
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	385,294	-	385,294	-	7,894	2.05%
4	国際決済銀行等向け	-	-	-	-	-	-
5	我が国の地方公共団体向け	3,952	-	3,952	-	-	-
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	2,480	-	2,480	-	557	22.46%
7	国際開発銀行向け	10,815	-	10,815	-	-	-
8	地方公共団体金融機構向け	5,911	-	5,911	-	1,181	19.98%
9	我が国の政府関係機関向け	274,770	-	274,770	-	34,627	12.60%
10	地方三公社向け	-	-	-	-	-	-
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	545,428	19,010	545,428	3,802	120,716	21.98%
12	法人等向け	268,240	1,861	210,122	1,861	187,088	88.26%
13	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-	-	-	-
14	抵当権付住宅ローン	-	-	-	-	-	-
15	不動産取得等事業向け	11,732	-	11,732	-	11,732	100.00%
16	三月以上延滞等 (抵当権付住宅ローンを除く。)	559	-	559	-	838	149.91%
17	抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞	-	-	-	-	-	-
18	取立未済手形	-	-	-	-	-	-
19	信用保証協会等による保証付	-	-	-	-	-	-
20	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	-	-	-	-	-	-
21	出資等(重要な出資を除く。)	269,948	-	269,948	-	338,526	125.40%
22	合計	5,652,785	20,871	5,594,667	5,663	703,163	12.56%

【CR5】標準的手法・資産クラス及びリスク・ウェイト別の信用リスク・エクスポージャー

CR5 その1

(単位 百万円)

	リスク・ウェイト	信用リスク・エクスポージャーの額 (CCF・信用リスク削減手法適用後)					
		0%	10%	20%	35%	50%	75%
1	現金	-	-	-	-	-	-
2	日本国政府及び日本銀行向け	3,873,651	-	-	-	-	-
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	374,570	-	20	-	5,625	-
4	国際決済銀行等向け	-	-	-	-	-	-
5	我が国の地方公共団体向け	3,952	-	-	-	-	-
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	-	2,403	-	-	-
7	国際開発銀行向け	10,815	-	-	-	-	-
8	地方公共団体金融機構向け	-	8	5,902	-	-	-
9	我が国の政府関係機関向け	-	203,267	71,502	-	-	-
10	地方三公社向け	-	-	-	-	-	-
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	-	-	519,291	-	26,162	-
12	法人等向け	-	-	24,081	-	11,261	-
13	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-	-	-	-
14	抵当権付住宅ローン	-	-	-	-	-	-
15	不動産取得等事業向け	-	-	-	-	-	-
16	三月以上延滞等 (抵当権付住宅ローンを除く。)	-	-	-	-	-	-
17	抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞	-	-	-	-	-	-
18	取立未済手形	-	-	-	-	-	-
19	信用保証協会等による保証付	-	-	-	-	-	-
20	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	-	-	-	-	-	-
21	出資等(重要な出資を除く。)	-	-	-	-	-	-
22	合計	4,262,990	203,275	623,201	-	43,050	-

	資産クラス	信用リスク・エクスポージャーの額 (CCF・信用リスク削減手法適用後)				
		リスク・ウェイト	100%	150%	250%	1250%
1	現金	-	-	-	-	-
2	日本国政府及び日本銀行向け	-	-	-	-	3,873,651
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	5,078	-	-	-	385,294
4	国際決済銀行等向け	-	-	-	-	-
5	我が国の地方公共団体向け	-	-	-	-	3,952
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	76	-	-	-	2,480
7	国際開発銀行向け	-	-	-	-	10,815
8	地方公共団体金融機構向け	-	-	-	-	5,911
9	我が国の政府関係機関向け	-	-	-	-	274,770
10	地方三公社向け	-	-	-	-	-
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	3,776	-	-	-	549,230
12	法人等向け	176,640	-	-	-	211,984
13	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-	-	-
14	抵当権付住宅ローン	-	-	-	-	-
15	不動産取得等事業向け	11,732	-	-	-	11,732
16	三月以上延滞等 (抵当権付住宅ローンを除く。)	-	559	-	-	559
17	抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞	-	-	-	-	-
18	取立未済手形	-	-	-	-	-
19	信用保証協会等による保証付	-	-	-	-	-
20	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	-	-	-	-	-
21	出資等(重要な出資を除く。)	224,229	-	45,718	-	269,948
22	合計	421,534	559	45,718	-	5,600,330

【CCR1】 手法別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー額

(単位 百万円)

		再構築 コスト	アドオン	実効EPE	規制上の エクスポ ージャーの算 定に使用さ れる α	信用リスク 削減手法 適用後のエ クスポー ジャー	リスク・ア セットの額
1	SA-CCR	-	-		1.4	-	-
	カレント・エクスポージャー方式	464,731	643,560			839,577	316,493
2	期待エクスポージャー方式			-	-	-	-
3	信用リスク削減手法における簡便 手法					-	-
4	信用リスク削減手法における包括的 手法					565,804	358,702
5	エクスポージャー変動推計モデル					-	-
6	合計						675,195

【CCR2】 CVA リスクに対する資本賦課

(単位 百万円)

		信用リスク削減 手法適用後の エクスポ ージャー	リスク・アセット の額 (CVAリスク相 当額を8%で除 して得た額)
1	先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	-	-
2	(i) CVAバリュー・アット・リスクの額(乗数適用後)	-	-
3	(ii) CVAストレス・バリュー・アット・リスクの額(乗数適用後)	-	-
4	標準的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	731,999	537,603
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	731,999	537,603

【CCR3】業種別及びリスク・ウェイト別のカウンターパーティ信用リスク・エクスポージャー

CCR3 その1

(単位 百万円)

業種	リスク・ウェイト	与信相当額(信用リスク削減効果勘案後)		
		0%	10%	20%
1	日本国政府及び日本銀行向け	2,804	-	-
2	外国の中央政府及び中央銀行向け	2,009	-	6
3	国際決済銀行等向け	5,468	-	-
4	我が国の地方公共団体向け	-	-	-
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	-	55,113
6	国際開発銀行向け	17,287	-	-
7	地方公共団体金融機構向け	-	8,051	-
8	我が国の政府関係機関向け	-	17,583	-
9	地方三公社向け	-	-	-
10	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	-	-	781,219
11	法人等向け	-	-	7,595
12	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-
13	上記以外	-	-	-
14	合計	27,570	25,634	843,934

(単位 百万円)

業種	リスク・ウェイト	与信相当額(信用リスク削減効果勘案後)		
		50%	75%	100%
1	日本国政府及び日本銀行向け	-	-	-
2	外国の中央政府及び中央銀行向け	4	-	-
3	国際決済銀行等向け	-	-	-
4	我が国の地方公共団体向け	-	-	-
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け	623	-	-
6	国際開発銀行向け	-	-	-
7	地方公共団体金融機構向け	-	-	-
8	我が国の政府関係機関向け	-	-	-
9	地方三公社向け	-	-	-
10	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	508	-	268
11	法人等向け	7,658	-	499,179
12	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-
13	上記以外	-	-	-
14	合計	8,794	-	499,448

CCR3 その2

(単位 百万円)

業種	リスク・ウェイト	与信相当額(信用リスク削減効果勘案後)		
		150%	その他	合計
1	日本国政府及び日本銀行向け	-	-	2,804
2	外国の中央政府及び中央銀行向け	-	-	2,020
3	国際決済銀行等向け	-	-	5,468
4	我が国の地方公共団体向け	-	-	-
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	-	55,736
6	国際開発銀行向け	-	-	17,287
7	地方公共団体金融機構向け	-	-	8,051
8	我が国の政府関係機関向け	-	-	17,583
9	地方三公社向け	-	-	-
10	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	-	-	781,995
11	法人等向け	-	-	514,433
12	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-
13	上記以外	-	-	-
14	合計	-	-	1,405,382

【CCR5】担保の内訳

(単位 百万円)

		派生商品取引で使用される担保				レポ形式の取引で使用される担保	
		受入担保の公正価値		差入担保の公正価値		受入担保の公正価値	差入担保の公正価値
		分別管理されている	分別管理されていない	分別管理されている	分別管理されていない		
1	現金(国内通貨)	11,082	136,995	16,401	267,418	1,424,841	2,881,869
2	現金(その他通貨)	70,378	45,473	-	16,978	5,796,562	4,592,373
3	国内ソブリン債	10	33,252	-	6,799	1,607,512	1,326,021
4	その他ソブリン債	676	-	-	-	4,301,914	4,700,514
5	政府関係機関債	3,788	-	-	-	752,142	1,101,227
6	社債	30,448	-	-	-	45,771	194,634
7	株式	18,944	-	55,787	-	714,496	318,902
8	その他担保	4,020	-	-	-	15,908	47,264
9	合計	139,347	215,719	72,188	291,195	14,659,147	15,162,803

(注) CCR5 では信用リスク削減手法に適用される担保の額を開示しております。

【CCR6】 クレジット・デリバティブ取引のエクスポージャー

(単位 百万円)

		購入した プロテクション	提供した プロテクション
	想定元本		
1	シングルネーム・クレジット・デフォルト・スワップ	698,974	850,940
2	インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ	524,699	410,154
3	トータル・リターン・スワップ	-	-
4	クレジットオプション	-	-
5	その他のクレジット・デリバティブ	-	-
6	想定元本合計	1,223,675	1,261,095
	公正価値		
7	プラスの公正価値(資産)	1,723	17,793
8	マイナスの公正価値(負債)	▲ 18,305	▲ 5,162

【CCR8】 中央清算機関向けエクスポージャー

(単位 百万円)

		中央清算機関向け エクスポージャー (信用リスク削減手 法適用後)	リスク・アセットの額
1	適格中央清算機関へのエクスポージャー(合計)		32,038
2	適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー (当初証拠金を除く。)	829,036	16,580
3	(i) 派生商品取引(上場以外)	579,082	11,581
4	(ii) 派生商品取引(上場)	126,523	2,530
5	(iii) レポ形式の取引	123,430	2,468
6	(iv) クロスプロダクト・ネットリングが承認された場合 のネットリング・セット	-	-
7	分別管理されている当初証拠金	80,487	
8	分別管理されていない当初証拠金	94,984	1,720
9	事前拠出された清算基金	53,108	13,737
10	未拠出の清算基金	-	-
11	非適格中央清算機関へのエクスポージャー(合計)		-
12	非適格中央清算機関に対するトレード・エクスポージャー (当初証拠金を除く。)	-	-
13	(i) 派生商品取引(上場以外)	-	-
14	(ii) 派生商品取引(上場)	-	-
15	(iii) レポ形式の取引	-	-
16	(iv) クロスプロダクト・ネットリングが承認された場合 のネットリング・セット	-	-
17	分別管理されている当初証拠金	-	
18	分別管理されていない当初証拠金	-	-
19	事前拠出された清算基金	-	-
20	未拠出の清算基金	-	-

【SEC1】原資産の種類別の証券化エクスポージャー（信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーに限る。）

(単位 百万円)

	原資産の種類	自金融機関がオリジネーター		
		資産譲渡型 証券化取引	合成型 証券化取引	小計
1	リテール(合計)	-	-	-
2	担保付住宅ローン	-	-	-
3	クレジットカード債権	-	-	-
4	その他リテールに係るエクスポージャー	-	-	-
5	再証券化	-	-	-
6	ホールセール(合計)	-	-	-
7	事業法人向けローン	-	-	-
8	商業用モーゲージ担保証券	-	-	-
9	リース債権及び売掛債権	-	-	-
10	その他のホールセール	-	-	-
11	再証券化	-	-	-

	原資産の種類	自金融機関がスポンサー		
		資産譲渡型 証券化取引	合成型 証券化取引	小計
1	リテール(合計)	-	-	-
2	担保付住宅ローン	-	-	-
3	クレジットカード債権	-	-	-
4	その他リテールに係るエクスポージャー	-	-	-
5	再証券化	-	-	-
6	ホールセール(合計)	-	-	-
7	事業法人向けローン	-	-	-
8	商業用モーゲージ担保証券	-	-	-
9	リース債権及び売掛債権	-	-	-
10	その他のホールセール	-	-	-
11	再証券化	-	-	-

	原資産の種類	自金融機関が投資家		
		資産譲渡型 証券化取引	合成型 証券化取引	小計
1	リテール(合計)	118,683	-	118,683
2	担保付住宅ローン	65,466	-	65,466
3	クレジットカード債権	111	-	111
4	その他リテールに係るエクスポージャー	53,105	-	53,105
5	再証券化	-	-	-
6	ホールセール(合計)	623,504	-	623,504
7	事業法人向けローン	-	-	-
8	商業用モーゲージ担保証券	-	-	-
9	リース債権及び売掛債権	920	-	920
10	その他のホールセール	622,584	-	622,584
11	再証券化	-	-	-

【SEC2】原資産の種類別の証券化エクスポージャー（マーケット・リスク相当額の算出対象となっている証券化エクスポージャーに限る。）

（単位 百万円）

	原資産の種類	自金融機関がオリジネーター		
		資産譲渡型 証券化取引	合成型 証券化取引	小計
1	リテール(合計)	-	-	-
2	担保付住宅ローン	-	-	-
3	クレジットカード債権	-	-	-
4	その他リテールに係るエクスポージャー	-	-	-
5	再証券化	-	-	-
6	ホールセール(合計)	2,054	-	2,054
7	事業法人向けローン	2,054	-	2,054
8	商業用モーゲージ担保証券	-	-	-
9	リース債権及び売掛債権	-	-	-
10	その他のホールセール	-	-	-
11	再証券化	-	-	-

	原資産の種類	自金融機関がスポンサー		
		資産譲渡型 証券化取引	合成型 証券化取引	小計
1	リテール(合計)	-	-	-
2	担保付住宅ローン	-	-	-
3	クレジットカード債権	-	-	-
4	その他リテールに係るエクスポージャー	-	-	-
5	再証券化	-	-	-
6	ホールセール(合計)	-	-	-
7	事業法人向けローン	-	-	-
8	商業用モーゲージ担保証券	-	-	-
9	リース債権及び売掛債権	-	-	-
10	その他のホールセール	-	-	-
11	再証券化	-	-	-

	原資産の種類	自金融機関が投資家		
		資産譲渡型 証券化取引	合成型 証券化取引	小計
1	リテール(合計)	164	-	164
2	担保付住宅ローン	164	-	164
3	クレジットカード債権	-	-	-
4	その他リテールに係るエクスポージャー	-	-	-
5	再証券化	-	-	-
6	ホールセール(合計)	-	-	-
7	事業法人向けローン	-	-	-
8	商業用モーゲージ担保証券	-	-	-
9	リース債権及び売掛債権	-	-	-
10	その他のホールセール	-	-	-
11	再証券化	-	-	-

【SEC3】信用リスク・アセットの額の算出対象となる証券化エクスポージャー及び関連する所要自己資本（自金融機関がオリジネーター又はスポンサーである場合）

該当ありません。

【SEC4】信用リスク・アセットの額の算出対象となる証券化エクスポージャー及び関連する所要自己資本（自金融機関が投資家である場合）

SEC4 その1

(単位 百万円)

		合計				
		資産譲渡型 証券化取引 (小計)	証券化			
			裏付けとなる リテール	ホール セール		
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)						
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	742,187	742,187	742,187	118,683	623,504
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
4	100%超125%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
5	125%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
エクスポージャーの額(算出方法別)						
6	内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
7	内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
8	標準的手法が適用される証券化エクスポージャー	742,187	742,187	742,187	118,683	623,504
9	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により125%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
信用リスク・アセットの額(算出方法別)						
10	内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
11	内部格付手法における指定関数方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
12	標準的手法により算出した信用リスク・アセット	148,437	148,437	148,437	23,736	124,700
13	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により125%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
所要自己資本の額(算出方法別)						
14	内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-
15	内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-
16	標準的手法が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	11,875	11,875	11,875	1,898	9,976
17	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により125%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-

		合計				
		資産譲渡型証券化取引(小計)			合成型証券化取引(小計)	
		再証券化	シニア	非シニア	証券化	証券化
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)						
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
4	100%超1250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
5	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
エクスポージャーの額(算出方法別)						
6	内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
7	内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
8	標準的手法が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
9	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
信用リスク・アセットの額(算出方法別)						
10	内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
11	内部格付手法における指定関数方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
12	標準的手法により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
13	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
所要自己資本の額(算出方法別)						
14	内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-
15	内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-
16	標準的手法が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-
17	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-

		合計				
		合成型証券化取引(小計)				
		証券化		再証券化		
		裏付けとなる リテール	ホールセール		シニア	非シニア
	エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)					
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
4	100%超1250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
5	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
	エクスポージャーの額(算出方法別)					
6	内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
7	内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
8	標準的手法が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
9	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
	信用リスク・アセットの額(算出方法別)					
10	内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
11	内部格付手法における指定関数方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
12	標準的手法により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
13	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
	所要自己資本の額(算出方法別)					
14	内部格付手法における外部格付準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-
15	内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-
16	標準的手法が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-
17	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-

【MR1】標準的方式によるマーケット・リスク相当額

(単位 百万円)

		リスク・アセット (リスク相当額を8パーセントで 除して得た額)
1	金利リスク(一般市場リスク及び個別リスク)の額	638,388
2	株式リスク(一般市場リスク及び個別リスク)の額	209,630
3	外国為替リスクの額	70,103
4	コモディティ・リスクの額	-
	オプション取引	
5	簡便法により算出した額	-
6	デルタ・プラス法により算出した額	-
7	シナリオ法により算出した額	-
8	証券化エクスポージャーに係る個別リスクの額	22,118
9	合計	940,241

【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)

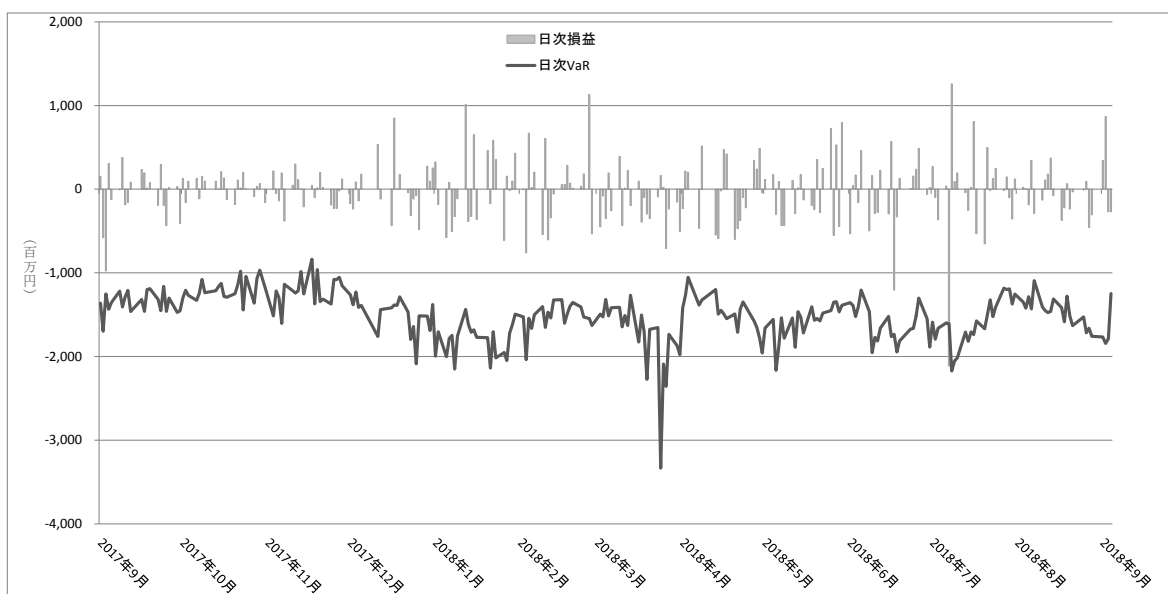
	前四半期末:2018年6月末 当四半期末:2018年9月末	バリュー・ アット・リスク	ストレス・ バリュー・ アット・リスク	追加的 リスク	包括的 リスク	その他	合計
1a	前四半期末におけるリスク・アセット	176,889	338,164	-	-		515,053
1b	前四半期末における連結自己資本規 制上のリスク・アセット額への調整	7	6	-	-		6
1c	前四半期末の算出基準日における内 部モデル方式の算出額	24,703	60,454	-	-		85,158
2	当四半期の 要因別の 変動額	リスク量の変動	21,493	98,908	-	-	120,402
3		モデルの更新又は変更	-	-	-	-	-
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	46,196	159,363	-	-	
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	5	3	-	-		3
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	213,860	401,821	-	-		615,682

【MR3】 内部モデル方式の状況（マーケット・リスク）

（単位 百万円）

	バリュー・アット・リスク(保有期間 10営業日、片側信頼区間 99%)	
1	最大値	8,495
2	平均値	4,700
3	最小値	1,743
4	期末	3,695
	ストレス・バリュー・アット・リスク(保有期間 10営業日、片側信頼区間 99%)	
5	最大値	17,812
6	平均値	9,532
7	最小値	4,346
8	期末	12,749
	追加的リスクの額(片側信頼区間 99.9%)	
9	最大値	-
10	平均値	-
11	最小値	-
12	期末	-
	包括的リスクの額(片側信頼区間 99.9%)	
13	最大値	-
14	平均値	-
15	最小値	-
16	期末	-
17	フロア(修正標準的方式)	-

【MR4】 内部モデル方式のバック・テストの結果



【IRRBB1】 金利リスク

(単位 百万円)

		△EVE	
		2018年9月末	2017年9月末
1	上方パラレルシフト	4,555	
2	下方パラレルシフト	27,769	
3	スティープ化	2,037	
4	フラット化	587	
5	短期金利上昇	1,755	
6	短期金利低下	15,753	
7	最大値	27,769	
		2018年9月末	2017年9月末
8	Tier1 資本の額	1,111,476	1,134,487

(注) トレーディング業務以外から生じる金利リスクにかかる損益の変動が当社に与える影響は極めて僅少のため△NIIについては開示を省略しております。

■ 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	2018年9月末	2017年9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	11,558,980	11,866,214
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	20,963,519	20,381,308
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(△)	9,404,539	8,515,094
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(△)	167,029	147,784
3		オン・バランス資産の額 (イ)	11,391,951	11,718,430
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	421,102	475,702
5		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	1,331,249	1,319,365
		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	309,389	276,284
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(△)	92,504	107,336
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	1,261,095	1,711,513
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(△)	996,293	1,408,060
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	2,234,038	2,267,468
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	7,295,941	6,753,882
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	1,718,286	1,423,824
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	183,463	159,855
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)	5,761,118	5,489,913
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	124,169	62,526
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(△)	52,804	13,763
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	71,365	48,763
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	1,111,476	1,134,487
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	19,458,472	19,524,574
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	5.71%	5.81%

2. 前中間事業年度の連結レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた原因

当中間事業年度と前中間事業年度の連結レバレッジ比率の差異はありません。

■ 自己資本調達手段に関する契約内容の概要

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	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	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	1,194,962 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	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	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	167百万円	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	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	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	202百万円	270百万円
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	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	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	236百万円	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	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	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	229百万円	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	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	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	230百万円	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	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	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	978百万円	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	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	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	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	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	838百万円	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	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	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	299百万円	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	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	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	329百万円	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	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	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	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		
	連結自己資本規制比率	134百万円	26百万円
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	2018年2月8日	2018年8月10日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2027年6月27日	2028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	—	—

以上