

2019年4月25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12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12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		2018年 12月末	2018年 9月末	2018年 6月末	2018年 3月末	2017年 12月末
資本						
1	普通株式等Tier1 資本の額	1,085,262	1,111,476	1,134,950	1,142,340	1,142,707
2	Tier1資本の額	1,085,262	1,111,476	1,134,950	1,142,340	1,142,707
3	総自己資本の額	1,085,262	1,111,476	1,134,950	1,142,340	1,142,707
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	4,911,966	5,234,732	4,989,109	5,125,879	5,257,936
自己資本比率						
5	連結普通株式等 Tier1比率	22.09%	21.23%	22.74%	22.28%	21.73%
6	連結Tier1比率	22.09%	21.23%	22.74%	22.28%	21.73%
7	連結総自己資本 比率	22.09%	21.23%	22.74%	22.28%	21.73%
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%	1.87%	1.25%
9	カウンター・シクリカル ・バッファー比率	0.02%	0.01%	0.01%	0.00%	0.00%
10	G-SIB/D-SIBバッ ファー比率	0.37%	0.37%	0.37%	0.37%	0.25%
11	最低連結資本バッ ファー比率	2.27%	2.26%	2.26%	2.25%	1.50%
12	連結資本バッファー 比率	14.09%	13.23%	14.74%	14.28%	13.73%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャー の額	20,199,002	19,458,472	19,902,398	20,358,038	20,987,142
14	連結レバレッジ比率	5.37%	5.71%	5.70%	5.61%	5.44%

■ 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12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	1,191,066
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	792,409
1c	うち、自己株式の額(△)	79,374
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	8,630
3	その他の包括利益累計額及びその他公表準備金の額	44,610
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)	1,244,307
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	113,894
8	うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	11,017
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	102,876
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	256
11	繰延ヘッジ損益の額	▲ 92
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	265
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	15,972
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	28,746
28	普通株式等Tier1資本に係る調整項目の額 (ロ)	159,044
普通株式等Tier1資本		
29	普通株式等Tier1資本の額 ((イ) - (ロ)) (ハ)	1,085,262

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目	2018年12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	7,093
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	21,653
43		その他Tier1資本に係る調整項目の額	(ホ) 28,746
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) 1,085,262
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12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		21,653
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)		21,653
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)		1,085,262
リスク・アセット (5)			
60	リスク・アセットの額の合計額 (ワ)		4,911,966
連結自己資本規制比率			
61	連結普通株式等Tier1比率 ((ハ) / (ワ))		22.09%
62	連結Tier1比率 ((ト) / (ワ))		22.09%
63	連結総自己資本規制比率 ((ル) / (ワ))		22.09%
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		112,998
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		42,767
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		5,209
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	3,623,007	3,623,007
	預託金	318,417	318,417
	受取手形及び売掛金	18,358	18,358
18, 39, 54, 72, 73	有価証券	1,083,724	1,083,724
16, 18, 39, 54, 72, 73	トレーディング商品	7,347,010	7,347,010
	約定見返勘定	-	-
18, 39, 54, 72, 73	営業投資有価証券	108,379	108,379
	投資損失引当金	▲ 450	▲ 450
	営業貸付金	1,618,641	1,618,641
	仕掛品	1,579	1,579
	信用取引資産	184,046	184,046
	有価証券担保貸付金	5,796,273	5,796,273
	立替金	9,400	9,400
	短期貸付金	2,078	2,078
	未収収益	52,150	52,150
10, 75	繰延税金資産	-	-
	その他の流動資産	566,595	566,595
	貸倒引当金	▲ 282	▲ 282
	流動資産計	20,728,931	20,728,931
	固定資産		
	有形固定資産	147,219	147,219
	無形固定資産	113,894	113,894
8	のれん	11,017	11,017
9	のれん以外	102,876	102,876
	投資その他の資産	439,159	439,159
18, 39, 54, 72, 73	投資有価証券	378,567	378,567
10, 75	繰延税金資産	5,466	5,466
	上記以外	55,125	55,125
	固定資産計	700,272	700,272
	繰延資産計	-	-
	資産合計	21,429,204	21,429,204

(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	7,571	7,571
	トレーディング商品	4,842,796	4,842,796
	約定見返勘定	364,120	364,120
	信用取引負債	57,286	57,286
	有価証券担保借入金	6,147,585	6,147,585
	銀行業における預金	3,606,019	3,606,019
	預り金	340,332	340,332
	受入保証金	403,279	403,279
	短期借入金	1,071,957	1,071,957
	コマーシャルペーパー	130,000	130,000
	1年内償還予定の社債	167,399	167,399
	未払法人税等	2,139	2,139
	繰延税金負債	-	-
	賞与引当金	17,359	17,359
	その他の流動負債	131,838	131,838
	固定負債		
	社債	1,393,514	1,393,514
	長期借入金	1,411,687	1,411,687
	繰延税金負債	7,692	7,692
	退職給付に係る負債	43,230	43,230
	訴訟損失引当金	25,063	25,063
	負ののれん	-	-
	その他の固定負債	6,909	6,909
	特別法上の準備金	3,945	3,945
	負債合計	20,181,728	20,181,728
	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	792,409	792,409
1c	自己株式	▲ 79,374	▲ 79,374
1c	自己株式申込証拠金	-	-
	株主資本合計	1,191,066	1,191,066
	その他の包括利益累計額		
	その他有価証券評価差額金	43,759	43,759
11	繰延ヘッジ損益	▲ 3,216	▲ 3,216
	為替換算調整勘定	4,068	4,068
3	その他の包括利益累計額	44,610	44,610
1b	新株予約権	8,630	8,630
34-35, 48-49	非支配株主持分	3,168	3,168
	純資産合計	1,247,475	1,247,475

■ 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	1,191,066 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類	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	269百万円
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類	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	231百万円	315百万円
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類	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	224百万円	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	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類	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	224百万円	432百万円
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類	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	975百万円	365百万円
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類	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類	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	896百万円	380百万円
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類	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	328百万円	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類別	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	381百万円	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類	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	186百万円	66百万円
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類	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	—	—

■ 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	
		2018年 12月末	2018年 9月末	2018年 12月末	2018年 9月末
1	信用リスク	853,398	884,040	68,271	70,723
2	うち、標準的手法適用分	675,740	703,163	54,059	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	177,658	180,877	14,212	14,470
4	カウンターパーティ信用リスク	1,183,985	1,244,837	94,718	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	310,811	316,493	24,864	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	512,779	537,603	41,022	43,008
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	30,519	32,038	2,441	2,563
	その他	329,874	358,702	26,389	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	404,549	394,470	32,363	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	109	165	8	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	140,360	148,437	11,228	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	140,360	148,437	11,228	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	1,334,804	1,555,923	106,784	124,473
17	うち、標準的方式適用分	847,602	940,241	67,808	75,219
18	うち、内部モデル方式適用分	487,201	615,682	38,976	49,254
19	オペレーショナル・リスク	981,734	992,187	78,538	79,375
20	うち、基礎的手法適用分	981,734	992,187	78,538	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	13,023	14,670	1,041	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	4,911,966	5,234,732	392,957	418,778

【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9月末 当四半期末:2018年12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	213,860	401,821	-	-		615,682
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	5	3	-	-		3
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	46,196	159,363	-	-		205,560
2	当四半期の 要因別の 変動額	リスク量の変動	▲ 12,119	▲ 59,962	-	-	▲ 72,081
3		モデルの更新又は変更	30,625	96,678	-	-	127,304
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	64,703	196,079	-	-	
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	3	2	-	-		2
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	176,487	310,714	-	-		487,201

■ 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12月末	2018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	12,510,330	11,558,980
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	21,429,204	20,963,519
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(△)	8,918,874	9,404,539
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(△)	159,044	167,029
3		オン・バランス資産の額 (イ)	12,351,286	11,391,951
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	421,620	421,102
5		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	1,323,310	1,331,249
		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	330,548	309,389
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(△)	108,051	92,504
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	1,072,359	1,261,095
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(△)	805,099	996,293
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	2,234,687	2,234,038
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	7,467,690	7,295,941
13		レボ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	2,093,412	1,718,286
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	161,425	183,463
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)	5,535,703	5,761,118
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	117,400	124,169
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(△)	40,074	52,804
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	77,326	71,365
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	1,085,262	1,111,476
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	20,199,002	19,458,472
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	5.37%	5.71%

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との間に著しい差異はありません。

以上

<お問い合わせ先>

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