

2020年4月30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 (2019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
(2019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と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係.....	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】 主要な指標

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号		2019年 12月末	2019年 9月末	2019年 6月末	2019年 3月末	2018年 12月末
資本						
1	普通株式等Tier1 資本の額	1,088,942	1,061,011	1,074,541	1,086,889	1,081,295
2	Tier1資本の額	1,088,942	1,061,011	1,074,541	1,086,889	1,081,295
3	総自己資本の額	1,088,942	1,061,011	1,074,541	1,086,889	1,081,295
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	5,593,840	5,572,157	5,089,921	5,020,849	4,988,639
自己資本比率						
5	連結普通株式等 Tier1比率	19.46%	19.04%	21.11%	21.64%	21.67%
6	連結Tier1比率	19.46%	19.04%	21.11%	21.64%	21.67%
7	連結総自己資本 比率	19.46%	19.04%	21.11%	21.64%	21.67%
資本バッファー						
8	資本保全バッファー 比率	2.50%	2.50%	2.50%	2.50%	1.87%
9	カウンター・シクリカ ル・バッファー比率	0.03%	0.03%	0.02%	0.02%	0.02%
10	G-SIB/D-SIBバッ ファー比率	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%	0.37%
11	最低連結資本バッ ファー比率	3.03%	3.03%	3.02%	3.02%	2.27%
12	連結資本バッファー 比率	11.46%	11.04%	13.11%	13.64%	13.67%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャー の額	21,601,323	19,417,404	19,816,310	18,674,804	20,092,466
14	連結レバレッジ比率	5.04%	5.46%	5.42%	5.82%	5.38%

■ 自己資本の構成に関する開示事項

【CC1】 自己資本の構成

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目	当最終指定親会社 四半期末	別紙様式第八号 (CC2)の参照項目
普通株式等Tier1資本に係る基礎項目 (1)			
1a+2-1c-26	普通株式に係る株主資本の額	1,192,360	
1a	うち、資本金及び資本剰余金の額	478,030	(i), (j)
2	うち、利益剰余金の額	825,098	(k)
1c	うち、自己株式の額 (△)	110,768	(l), (m)
26	うち、社外流出予定額(△)	-	
	うち、上記以外に該当するものの額	-	
1b	普通株式に係る新株予約権の額	8,870	(p)
3	その他の包括利益累計額及びその他公表準備金の額	49,494	(o)
5	普通株式等Tier1資本に係る調整後非支配株主持分の額	-	
6	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額 (イ)	1,250,725	
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	150,871	
8	うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	42,453	(e), (g)
9	うち、のれん及びモーゲージ・サービシング・ライツに係るもの以外のものの額	108,418	(f)
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	330	(d), (h)
11	繰延ヘッジ損益の額	▲ 67	(n)
12	適格引当金不足額	-	
13	証券化取引に伴い増加した自己資本に相当する額	-	
14	負債の時価評価により生じた時価評価差額であって自己資本に算入される額	335	
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	108	(b)
17	意図的に保有している他の金融機関等の普通株式の額	-	
18	少数出資金融機関等の普通株式の額	9,893	(a), (b), (c), (g)
19+20+21	特定項目に係る十パーセント基準超過額	-	
19	うち、その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に該当するものに関連するものの額	-	
20	うち、無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に関連するものの額	-	
21	うち、繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に関連するものの額	-	
22	特定項目に係る十五パーセント基準超過額	-	
23	うち、その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に該当するものに関連するものの額	-	
24	うち、無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に関連するものの額	-	
25	うち、繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に関連するものの額	-	
27	その他Tier1資本不足額	311	
28	普通株式等Tier1資本に係る調整項目の額 (ロ)	161,782	
普通株式等Tier1資本			
29	普通株式等Tier1資本の額 ((イ) - (ロ)) (ハ)	1,088,942	

(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	別紙様式第八号 (CC2)の参照項目
その他Tier1資本に係る基礎項目 (3)			
30	31a	その他Tier1資本調達手段に係る株主資本の額及びその内訳	-
	31b	その他Tier1資本調達手段に係る新株予約権の額	-
	32	その他Tier1資本調達手段に係る負債の額	-
		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	6,525	(q)
33+35	適格旧Tier1資本調達手段の額のうちその他Tier1資本に係る基礎項目の額に含まれる額	-	
33	うち、最終指定親会社及び最終指定親会社の特別目的会社等の発行する資本調達手段の額	-	
35	うち、最終指定親会社の連結子法人等(最終指定親会社の特別目的会社等を除く。)の発行する資本調達手段の額	-	
36	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 (ニ)	6,525	
その他Tier1資本に係る調整項目			
37	自己保有その他Tier1資本調達手段の額	-	
38	意図的に保有している他の金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額	-	
39	少数出資金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額	2,563	(a), (b), (c), (g)
40	その他金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額	-	
42	Tier2資本不足額	4,273	
43	その他Tier1資本に係る調整項目の額 (ホ)	6,836	
その他Tier1資本			
44	その他Tier1資本の額 ((ニ) - (ホ)) (ヘ)	-	
Tier1資本			
45	Tier1資本の額 ((ハ) + (ヘ)) (ト)	1,088,942	
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	1,535	(q)
47+49	適格旧Tier2資本調達手段の額のうちTier2資本に係る基礎項目の額に含まれる額	-	
47	うち、最終指定親会社及び最終指定親会社の特別目的会社等の発行する資本調達手段の額	-	
49	うち、最終指定親会社の連結子法人等(最終指定親会社の特別目的会社等を除く。)の発行する資本調達手段の額	-	
50	一般貸倒引当金Tier2算入額及び適格引当金Tier2算入額の合計額	-	
50a	うち、一般貸倒引当金Tier2算入額	-	
50b	うち、適格引当金Tier2算入額	-	
51	Tier2資本に係る基礎項目の額 (チ)	1,535	

(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	別紙様式第八号 (CC2)の参照項目
Tier2資本に係る調整項目			
52	自己保有Tier2資本調達手段の額	-	
53	意図的に保有している他の金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額	-	
54	少数出資金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額	5,808	(a), (b), (c), (g)
54a	少数出資金融機関等のその他外部TLAC 関連調達手段のうち、マーケット・メイク目的保有TLACに該当しなくなったものの額	-	
55	その他金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC 関連調達手段の額	-	
57	Tier2資本に係る調整項目の額 (リ)	5,808	
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)	1,088,942	
リスク・アセット (5)			
60	リスク・アセットの額の合計額 (ヲ)	5,593,840	
連結自己資本規制比率			
61	連結普通株式等Tier1比率 ((ハ) / (ヲ))	19.46%	
62	連結Tier1比率 ((ト) / (ヲ))	19.46%	
63	連結総自己資本規制比率 ((ル) / (ヲ))	19.46%	
64	最低連結資本バッファ比率	3.03%	
65	うち、資本保全バッファ比率	2.50%	
66	うち、カウンター・シクリカル・バッファ比率	0.03%	
67	うち、G-SIB/D-SIB バッファ比率	0.50%	
68	連結資本バッファ比率	11.46%	
調整項目に係る参考事項 (6)			
72	少数出資金融機関等の対象資本等調達手段に係る調整項目不算入額	109,914	(a), (b), (c), (g)
73	その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に係る調整項目不算入額	65,180	(a), (b), (c), (g)
74	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に係る調整項目不算入額	-	
75	繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に係る調整項目不算入額	6,864	(d), (h)
Tier2資本に係る基礎項目の額に算入される引当金に関する事項 (7)			
76	一般貸倒引当金の額	-	
77	一般貸倒引当金に係るTier2資本算入上限額	-	
78	内部格付手法採用最終指定親会社において、適格引当金の合計額から事業法人等向けエクスポージャー及びリテール向けエクスポージャーの期待損失額の合計額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-	
79	適格引当金に係るTier2資本算入上限額	-	
資本調達手段に係る経過措置に関する事項 (8)			
82	適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額	-	
83	適格旧Tier1資本調達手段の額から適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-	
84	適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額	-	
85	適格旧Tier2資本調達手段の額から適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-	

■ 定性的な開示事項

1. 連結貸借対照表の科目と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係

【CC2】 連結貸借対照表の科目と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係

(単位: 百万円)

項目	公表 連結貸借対照表	規制上の連結範囲に基づく 連結貸借対照表	別紙様式第一号 (CC1)の参照項目
資産の部			
流動資産			
現金・預金	4,307,755	4,337,877	
預託金	377,453	377,453	
受取手形及び売掛金	18,061	18,061	
有価証券 (a)	899,315	899,315	18, 39, 54, 72, 73
トレーディング商品 (b)	7,347,359	7,347,359	16, 18, 39, 54, 72, 73
約定見返勘定	-	-	
営業投資有価証券 (c)	161,847	129,875	18, 39, 54, 72, 73
投資損失引当金	▲ 157	▲ 157	
営業貸付金	1,633,928	1,633,928	
仕掛品	1,237	1,237	
信用取引資産	151,774	151,774	
有価証券担保貸付金	8,013,908	8,013,908	
立替金	11,288	11,288	
短期貸付金	2,183	2,183	
未収収益	34,765	34,837	
繰延税金資産 (d)	-	-	10, 75
その他の流動資産	493,837	503,148	
貸倒引当金	▲ 349	▲ 349	
流動資産計	23,454,210	23,461,743	
固定資産			
有形固定資産	301,998	335,201	
無形固定資産	121,292	130,816	
のれん (e)	13,970	22,398	8
のれん以外 (f)	107,321	108,418	9
投資その他の資産	531,951	544,379	
投資有価証券 (g)	492,131	472,057	8, 18, 39, 54, 72, 73
繰延税金資産 (h)	6,726	7,195	10, 75
上記以外	33,093	65,126	
固定資産計	955,242	1,010,397	
繰延資産計	-	-	
資産の部合計	24,409,452	24,472,141	

(単位 百万円)

項目	公表 連結貸借対照表	規制上の連結範囲に基づく 連結貸借対照表	別紙様式第一号 (CC1)の参照項目
負債の部			
流動負債			
支払手形及び買掛金	6,600	6,600	
トレーディング商品	4,894,829	4,894,829	
約定見返勘定	701,667	701,667	
信用取引負債	75,550	75,550	
有価証券担保借入金	8,436,722	8,436,722	
銀行業における預金	4,260,190	4,260,190	
預り金	371,698	378,908	
受入保証金	363,478	363,478	
短期借入金	748,150	748,187	
コマーシャルペーパー	200,000	200,000	
1年内償還予定の社債	316,406	316,406	
未払法人税等	2,129	2,202	
繰延税金負債	-	-	
賞与引当金	17,861	17,861	
その他の流動負債	103,376	123,660	
固定負債			
社債	1,198,778	1,198,778	
長期借入金	1,335,860	1,344,809	
繰延税金負債	9,507	9,526	
退職給付に係る負債	44,228	44,228	
訴訟損失引当金	1,648	1,648	
負ののれん	-	-	
その他の固定負債	29,663	34,374	
特別法上の準備金	3,938	3,938	
負債の部合計	23,122,287	23,163,572	
純資産の部			
株主資本			
資本金 (i)	247,397	247,397	1a
資本剰余金 (j)	230,633	230,633	1a
利益剰余金 (k)	823,269	825,098	2
自己株式 (l)	▲ 110,772	▲ 110,772	1c
自己株式申込証拠金 (m)	4	4	1c
株主資本合計	1,190,532	1,192,360	
その他の包括利益累計額			
その他有価証券評価差額金	51,090	51,090	
繰延ヘッジ損益 (n)	▲ 4,941	▲ 4,941	11
為替換算調整勘定	3,313	3,345	
その他の包括利益累計額 (o)	49,462	49,494	3
新株予約権 (p)	8,870	8,870	1b
非支配株主持分 (q)	38,299	57,843	34-35, 48-49
純資産の部合計	1,287,164	1,308,568	

■ 自己資本調達手段に関する契約内容の概要

【CCA】 自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要

1	発行者	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無
3	準拠法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—
	規制上の取り扱い (2)	
4	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 (3)	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	普通株式
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)	
	連結自己資本規制比率	1,190,532 百万円
9	額面総額 (5)	—
10	表示される科目の区分 (6)	
	連結貸借対照表	株主資本
11	発行日 (7)	—
12	償還期限の有無	無
13	その日付	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—
	剰余金の配当又は利息の支払	
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動
18	配当率又は利率 (12)	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—
25	転換の範囲 (16)	—
26	転換の比率 (17)	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—
34	その概要	—
34a	劣後性の手段(23)	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	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 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2006年7月発行新株予約権	2007年7月発行新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	141 百万円	192 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2006年7月1日	2007年7月1日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性的手段(23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	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 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2008年7月発行新株予約権	2009年7月発行新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	176 百万円	245 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2008年7月1日	2009年7月1日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性的手段(23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	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 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2010年7月発行新株予約権	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 (4)		
	連結自己資本規制比率	299 百万円	201 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2010年7月1日	2010年9月1日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性的手段(23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	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 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	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 (4)		
	連結自己資本規制比率	364 百万円	207 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2011年7月1日	2011年9月5日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性的手段(23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	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 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2013年2月発行新株予約権	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 (4)		
	連結自己資本規制比率	413 百万円	962 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2013年2月12日	2013年2月12日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性的手段(23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	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 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	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 (4)		
	連結自己資本規制比率	351 百万円	1,082 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2014年2月10日	2014年2月10日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性的手段(23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	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 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2015年2月発行新株予約権	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 (4)		
	連結自己資本規制比率	375 百万円	951 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2015年2月9日	2015年2月9日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性的手段(23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	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 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	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 (4)		
	連結自己資本規制比率	376 百万円	443 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2016年2月16日	2016年2月16日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性的手段(23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	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 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2017年2月発行新株予約権	第13回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	404 百万円	587 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2017年2月8日	2017年2月8日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性的手段(23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	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 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2018年2月発行新株予約権	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 (4)		
	連結自己資本規制比率	435 百万円	393 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2018年2月8日	2018年2月8日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性的手段(23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	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 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	第15回新株予約権	第16回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	224 百万円	39 百万円
9	額面総額 (5)	—	
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2018年8月10日	2019年8月15日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段(23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

■ 定量的な開示事項

1. その他定量的な開示事項

【OV1】 リスク・アセットの概要

(単位 百万円)

国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2019年 12月末	2019年 9月末	2019年 12月末	2019年 9月末
1	信用リスク	1,207,131	1,001,700	96,570	80,135
2	うち、標準的手法適用分	771,368	684,005	61,709	54,720
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	435,763	317,695	34,861	25,415
4	カウンターパーティ信用リスク	954,297	982,493	76,343	78,599
5	うち、SA-CCR適用分	335,232	326,211	26,818	26,096
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	333,474	329,919	26,677	26,393
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	19,954	16,191	1,596	1,295
	その他	265,635	310,170	21,250	24,813
7	マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	-	-	-	-
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（レック・スルー方式）	340,116	482,343	27,209	38,587
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（マンドート方式）	115,166	75,768	9,213	6,061
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式250%）	-	-	-	-
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式400%）	-	-	-	-
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（フォールバック方式1250%）	2,006	1,345	160	107
11	未決済取引	227	2,067	18	165
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	123,921	127,643	9,913	10,211
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	121,525	127,643	9,722	10,211
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	2,395	-	191	-
16	マーケット・リスク	1,750,411	1,766,164	140,032	141,293
17	うち、標準的方式適用分	923,905	899,319	73,912	71,945
18	うち、内部モデル方式適用分	826,506	866,845	66,120	69,347
19	オペレーショナル・リスク	948,297	955,149	75,863	76,411
20	うち、基礎的手法適用分	948,297	955,149	75,863	76,411
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	152,264	177,480	12,181	14,198
	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	5,593,840	5,572,157	447,507	445,772

【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:2019年9月末 当四半期末:2019年12月末	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	198,308	668,536	-	-		866,845
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	3.59	3.82	-	-		3.76
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	55,236	174,847	-	-		230,083
2	当四半期の 要因別の 変動額	リスク量の変動	▲ 8,903	▲ 44,734	-	-	▲ 53,638
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	46,332	130,112	-	-	
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	4.56	4.72	-	-		4.68
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	211,398	615,107	-	-		826,506

■ 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	2019年12月末	2019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	13,469,612	13,415,147
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	24,409,452	22,809,247
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。)	62,688	-
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(△)	11,002,528	9,394,100
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(△)	163,767	158,271
3		オン・バランス資産の額 (イ)	13,305,845	13,256,876
デリバティブ取引等に関する額 (2)				
4		デリバティブ取引等に関するRC の額に1.4 を乗じた額	487,212	496,185
5		デリバティブ取引等に関するPFE の額に1.4 を乗じた額	417,265	403,272
6		連結貸借対照表から控除されているデリバティブ取引等に関連して差し入れた担保の対価の額	-	-
7		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた変動証拠金の対価の額のうち控除する額(△)	94,317	190,393
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	1,169,472	1,254,709
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(△)	890,403	974,889
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	1,089,229	988,884
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	8,849,075	6,278,838
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	1,972,462	1,403,844
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	206,153	194,797
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)	7,082,766	5,069,791
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	190,145	152,665
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(△)	66,662	50,812
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	123,483	101,853
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	1,088,942	1,061,011
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	21,601,323	19,417,404
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	5.04%	5.46%

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