

2022年1月28日

各位

会社名 株式会社大和証券グループ本社
代表者名 執行役社長 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(2021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(2021年9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. 連結の範囲に関する事項.....	7
2. 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.....	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. 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が適用されるエクスポージャーについて、エクスポージャーの区分ごとの額.....	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】 主要な指標

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号		2021年 9月末	2021年 6月末	2021年 3月末	2020年 12月末	2020年 9月末
資本						
1	普通株式等Tier1 資本の額	1,148,768	1,152,962	1,123,656	1,079,983	1,034,222
2	Tier1資本の額	1,314,659	1,327,893	1,305,210	1,214,038	1,162,574
3	総自己資本の額	1,314,659	1,327,893	1,305,210	1,214,038	1,162,574
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	6,514,283	6,271,241	6,008,356	5,160,906	5,174,911
自己資本比率						
5	連結普通株式等 Tier1比率	17.63%	18.38%	18.70%	20.92%	19.98%
6	連結Tier1比率	20.18%	21.17%	21.72%	23.52%	22.46%
7	連結総自己資本 比率	20.18%	21.17%	21.72%	23.52%	22.46%
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%	2.50%
9	カウンター・シクリカ ル・バッファー比率	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
10	G-SIB/D-SIBバッ ファー比率	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%
11	最低連結資本バッ ファー比率	3.00%	3.00%	3.00%	3.00%	3.00%
12	連結資本バッファー 比率	12.18%	13.17%	13.72%	15.52%	14.46%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャー の額	18,239,765	18,785,385	18,916,695	18,282,142	18,436,197
14	連結レバレッジ比率	7.20%	7.06%	6.89%	6.64%	6.30%

■ 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	1,260,655	
1a	うち、資本金及び資本剰余金の額	477,934	(i), (j)
2	うち、利益剰余金の額	924,139	(k)
1c	うち、自己株式の額 (△)	115,723	(l), (m)
26	うち、社外流出予定額 (△)	25,693	
	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	9,094	(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	58,878	(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)	1,328,629	
	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	157,850	
8	うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	54,153	(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	103,696	(f)
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	265	(d), (h)
11	繰延ヘッジ損益の額	▲ 3,322	(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	321	
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	168	(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	24,577	(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	-	
28	普通株式等Tier1資本に係る調整項目の額 (ロ)	179,860	
	普通株式等Tier1資本		
29	普通株式等Tier1資本の額 ((イ) - (ロ)) (ハ)	1,148,768	

(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	149,700
		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	48,520	(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 (二)	198,220	
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	6,552	(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	25,776	
43	その他Tier1資本に係る調整項目の額 (ホ)	32,329	
その他Tier1資本			
44	その他Tier1資本の額 ((二) - (ホ)) (ヘ)	165,890	
Tier1資本			
45	Tier1資本の額 ((ハ) + (ヘ)) (ト)	1,314,659	
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	11,416	(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)	11,416	

(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	34,679	(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	2,513	
57	Tier2資本に係る調整項目の額 (リ)	37,193	
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)	1,314,659	
リスク・アセット (5)			
60	リスク・アセットの額の合計額 (ヲ)	6,514,283	
連結自己資本規制比率			
61	連結普通株式等Tier1比率 ((ハ) / (ヲ))	17.63%	
62	連結Tier1比率 ((ト) / (ヲ))	20.18%	
63	連結総自己資本規制比率 ((ル) / (ヲ))	20.18%	
64	最低連結資本バッファ比率	3.00%	
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	0.00%	
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	12.18%	
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	117,334	(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	73,347	(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	7,923	(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ア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

会社グループに属する会社は、会計連結範囲に含まれる会社に加え、銀行法施行規則に規定される業務を営む会社を含めているため、会計連結範囲に含まれる会社よりも連結の範囲は広範となっています。

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

125 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
株式会社大和総研	情報サービス業
株式会社大和証券ビジネスセンター	事務代行業
大和証券ファシリティーズ株式会社	不動産賃貸業・管理業
株式会社大和ネクスト銀行	銀行業
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
大和エナジー・インフラ株式会社	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
大和証券オフィス投資法人	特定資産に対する投資運用
サムティ・レジデンシャル投資法人	特定資産に対する投資運用
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

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は、以下のとおりです。

(単位 百万円)

会社グループに属する会社の名称	主要な業務の内容	総資産の額	純資産の額
大和証券エスエムビーシープリンシパル・インベストメンツ株式会社	投資業	1,912	1,903
大和インバスター・リレーションズ株式会社	企業のIR(投資家向け広報)活動に関するコンサルティング等の支援業務	631	421
DMS Ltd.	システムリユース、リサーチ、コンサルティング	230	197
Asian Energy Investments Pte., Ltd.	投資運用業、投資助言・代理業	296	269
大和ACAヘルスケア株式会社	投資ファンドの運営、アセットマネジメント、不動産関連事業	320	284
Daiwa Corporate Investment Asia Ltd.	投資業	116	80

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については、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	4,680,887	4,683,508	
預託金	602,795	602,795	
受取手形、売掛金及び契約資産	24,190	24,190	
有価証券 (a)	1,051,844	1,051,844	8, 18, 39, 54, 72, 73
トレーディング商品 (b)	6,824,827	6,824,827	16, 18, 39, 54, 72, 73
営業投資有価証券 (c)	100,150	100,150	18, 39, 54, 72, 73
投資損失引当金	▲ 215	▲ 215	
営業貸付金	1,938,394	1,938,394	
仕掛品	1,225	1,225	
信用取引資産	177,643	177,643	
有価証券担保貸付金	7,832,873	7,832,873	
立替金	30,544	30,544	
短期貸付金	796	796	
未収収益	40,378	40,457	
繰延税金資産 (d)	-	-	10, 75
その他の流動資産	741,570	741,930	
貸倒引当金	▲ 6,959	▲ 6,959	
流動資産計	24,040,947	24,044,007	
固定資産			
有形固定資産	880,893	880,991	
無形固定資産	122,043	122,105	
のれん (e)	20,020	20,020	8
のれん以外 (f)	102,022	102,084	9
投資その他の資産	466,922	465,569	
投資有価証券 (g)	428,413	427,025	8, 18, 39, 54, 72, 73
繰延税金資産 (h)	8,185	8,188	10, 75
上記以外	30,324	30,355	
固定資産計	1,469,859	1,468,666	
繰延資産計	-	-	
資産の部合計	25,510,806	25,512,673	

(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	5,289	5,289	
トレーディング商品	3,927,318	3,927,318	
約定見返勘定	745,360	745,360	
信用取引負債	67,567	67,567	
有価証券担保借入金	8,590,281	8,590,281	
銀行業における預金	4,291,472	4,291,472	
預り金	645,778	645,784	
受入保証金	349,108	349,108	
短期借入金	1,596,333	1,596,333	
コマーシャルペーパー	232,000	232,000	
1年内償還予定の社債	338,450	338,450	
未払法人税等	8,073	8,097	
繰延税金負債	-	-	
賞与引当金	29,469	29,469	
その他の流動負債	128,776	128,965	
固定負債			
社債	1,501,302	1,501,302	
長期借入金	1,295,236	1,295,236	
繰延税金負債	42,833	42,833	
退職給付に係る負債	44,594	44,594	
訴訟損失引当金	167	167	
負ののれん	-	-	
その他の固定負債	55,295	55,423	
特別法上の準備金	3,702	3,702	
負債の部合計	23,898,411	23,898,760	
純資産の部			
株主資本			
資本金 (i)	247,397	247,397	1a
資本剰余金 (j)	230,536	230,536	1a
利益剰余金 (k)	923,658	924,159	2
自己株式 (l)	▲ 115,729	▲ 115,729	1c
自己株式申込証拠金 (m)	5	5	1c
株主資本合計	1,285,869	1,285,869	
その他の包括利益累計額			
その他有価証券評価差額金	45,340	45,340	
繰延ヘッジ損益 (n)	▲ 4,112	▲ 4,112	11
為替換算調整勘定	17,604	17,648	
その他の包括利益累計額 (o)	58,833	58,833	3
新株予約権 (p)	9,094	9,094	1b
非支配株主持分 (q)	258,597	259,585	34-35, 48-49
純資産の部合計	1,612,395	1,613,929	

■ 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. 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が適用されるエクスポージャーについて、エクスポージャーの区分ごとの額

(単位 百万円)

	エクスポージャーの額
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(ルック・スルー方式)	604,308
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(マンデート方式)	31,401
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%)	12,784
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%)	-
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%)	374
合計	648,868

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	
		2021年 9月末	2020年 9月末	2021年 9月末	2020年 9月末
1	信用リスク	2,046,491	1,183,817	163,719	94,705
2	うち、標準的手法適用分	981,349	829,630	78,507	66,370
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	1,065,142	354,187	85,211	28,334
4	カウンターパーティ信用リスク	1,265,791	1,007,826	101,263	80,626
5	うち、SA-CCR適用分	529,115	409,182	42,329	32,734
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	475,370	333,877	38,029	26,710
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	20,081	19,211	1,606	1,536
	その他	241,224	245,554	19,297	19,644
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（リスク・スルー方式）	301,803	468,067	24,144	37,445
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）	28,556	20,880	2,284	1,670
	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%）	31,960	-	2,556	-
	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%）	4,677	983	374	78
11	未決済取引	4	37	0	3
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	128,212	115,557	10,257	9,244
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	125,850	113,190	10,068	9,055
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	2,362	2,367	189	189
16	マーケット・リスク	1,523,775	1,257,934	121,894	100,634
17	うち、標準的方式適用分	1,020,052	816,921	81,596	65,353
18	うち、内部モデル方式適用分	503,722	441,012	40,297	35,281
19	オペレーショナル・リスク	979,678	920,366	78,374	73,629
20	うち、基礎的手法適用分	979,678	920,366	78,374	73,629
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	203,330	199,440	16,266	15,955
	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	6,514,283	5,174,911	521,135	413,992

(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	
		2021年 9月末	2021年 6月末	2021年 9月末	2021年 6月末
1	信用リスク	2,046,491	2,045,484	163,719	163,638
2	うち、標準的手法適用分	981,349	989,122	78,507	79,129
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	1,065,142	1,056,362	85,211	84,508
4	カウンターパーティ信用リスク	1,265,791	1,155,183	101,263	92,414
5	うち、SA-CCR適用分	529,115	499,747	42,329	39,979
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	475,370	417,110	38,029	33,368
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	20,081	21,728	1,606	1,738
	その他	241,224	216,597	19,297	17,327
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（ブック・スルー方式）	301,803	278,236	24,144	22,258
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（マンドレイト方式）	28,556	28,312	2,284	2,264
	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%）	31,960	20,405	2,556	1,632
	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%）	4,677	4,450	374	356
11	未決済取引	4	16	0	1
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	128,212	125,473	10,257	10,037
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	125,850	123,111	10,068	9,848
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	2,362	2,362	189	189
16	マーケット・リスク	1,523,775	1,455,321	121,894	116,425
17	うち、標準的方式適用分	1,020,052	993,011	81,596	79,440
18	うち、内部モデル方式適用分	503,722	462,309	40,297	36,984
19	オペレーショナル・リスク	979,678	962,611	78,374	77,008
20	うち、基礎的手法適用分	979,678	962,611	78,374	77,008
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	203,330	195,745	16,266	15,659
	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	6,514,283	6,271,241	521,135	501,699

【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	-	1,378,704	10,213	1,368,491
2 有価証券(うち負債性のもの)	-	870,818	-	870,818
3 その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)	30,729	4,817,611	2,186	4,846,154
4 オン・バランスシートの資産の合計(1+2+3)	30,729	7,067,134	12,399	7,085,463
オフ・バランスシートの資産				
5 支払承諾等	-	13,032	-	13,032
6 コミットメント等	-	4,023	-	4,023
7 オフ・バランスシートの資産の合計(5+6)	-	17,056	-	17,056
合計				
8 合計(4+7)	30,729	7,084,190	12,399	7,102,520

(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:2021年3月末 当中間期末:2021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	30,862
2	デフォルトした額	-
3	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	-
4	非デフォルト状態へ復帰した額	-
5	償却された額	-
6	その他の変動額	▲ 133
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)	30,729

(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デフォルト状態にあるエクスポージャーの回収による残高減少が挙げられます。

【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	1,157,578	210,912	210,912	-	-
2 有価証券(負債性のもの)	870,818	-	-	-	-
3 その他オン・バランスシートの資産(負債性のもの)	4,846,149	4	4	-	-
4 合計(1+2+3)	6,874,546	210,916	210,916	-	-
5 うちデフォルトしたもの	30,625	-	-	-	-

【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	5,295,772	-	5,295,772	-	-	0.00%
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	126,743	-	126,743	-	15	0.01%
4	国際決済銀行等向け	-	-	-	-	-	-
5	我が国の地方公共団体向け	18,061	-	18,061	-	-	0.00%
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	2,113	-	2,113	-	1,561	73.88%
7	国際開発銀行向け	12,058	-	12,058	-	-	0.00%
8	地方公共団体金融機構向け	8,837	-	8,837	-	1,766	19.99%
9	我が国の政府関係機関向け	341,803	-	341,803	-	36,036	10.54%
10	地方三公社向け	0	-	0	-	0	20.00%
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	922,049	3,998	922,049	799	192,030	20.79%
12	法人等向け	649,349	14,159	438,432	13,267	434,020	96.09%
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	17,505	1,042	17,505	1,042	18,547	100.00%
16	三月以上延滞等 (抵当権付住宅ローンを除く。)	30,625	-	30,625	-	45,921	149.95%
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。)	251,449	-	251,449	-	251,449	100.00%
22	合計	7,676,371	19,201	7,465,454	15,109	981,349	13.12%

【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)

資産クラス	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	5,295,772	-	-	-	-	-
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	126,706	-	11	-	25	-
4	国際決済銀行等向け	-	-	-	-	-	-
5	我が国の地方公共団体向け	18,061	-	-	-	-	-
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	-	690	-	-	-
7	国際開発銀行向け	12,058	-	-	-	-	-
8	地方公共団体金融機構向け	-	10	8,827	-	-	-
9	我が国の政府関係機関向け	-	323,247	18,556	-	-	-
10	地方三公社向け	-	-	0	-	-	-
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	-	-	912,956	-	907	-
12	法人等向け	-	-	7,853	-	22,796	-
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。)	-	-	-	-	16	-
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	5,452,599	323,257	948,894	-	23,746	-

	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)				
		100%	150%	250%	1250%	合計
資産クラス						
1	現金	-	-	-	-	-
2	日本国政府及び日本銀行向け	-	-	-	-	5,295,772
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	0	-	-	-	126,743
4	国際決済銀行等向け	-	-	-	-	-
5	我が国の地方公共団体向け	-	-	-	-	18,061
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	1,423	-	-	-	2,113
7	国際開発銀行向け	-	-	-	-	12,058
8	地方公共団体金融機構向け	-	-	-	-	8,837
9	我が国の政府関係機関向け	-	-	-	-	341,803
10	地方三公社向け	-	-	-	-	0
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	8,985	-	-	-	922,849
12	法人等向け	421,049	-	-	0	451,699
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	18,547	-	-	-	18,547
16	三月以上延滞等 (抵当権付住宅ローンを除く。)	-	30,608	-	-	30,625
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。)	251,449	-	-	-	251,449
22	合計	701,456	30,608	-	0	7,480,563

【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)

		RC	PFE	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	221,947	396,848		1.4	866,314	529,115
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					474,066	241,224
5	エクスポージャー変動推計モデル					-	-
6	合計						770,340

【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	763,752	475,370
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	763,752	475,370

【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	1,341	-	-
2	外国の中央政府及び中央銀行向け	17,125	-	11,979
3	国際決済銀行等向け	71,868	-	-
4	我が国の地方公共団体向け	1,020	-	-
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	-	26,899
6	国際開発銀行向け	4,552	-	-
7	地方公共団体金融機構向け	-	-	2,977
8	我が国の政府関係機関向け	-	3,288	9,224
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	-	-	520,691
11	法人等向け	-	-	6,601
12	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-
13	上記以外	-	-	-
14	合計	95,907	3,288	578,373

(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	40	-	-
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	3,490	-	-
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	377	-	4
11	法人等向け	13,040	-	645,856
12	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-
13	上記以外	-	-	-
14	合計	16,949	-	645,861

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	-	-	1,341
2	外国の中央政府及び中央銀行向け	-	-	29,144
3	国際決済銀行等向け	-	-	71,868
4	我が国の地方公共団体向け	-	-	1,020
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	-	30,390
6	国際開発銀行向け	-	-	4,552
7	地方公共団体金融機構向け	-	-	2,977
8	我が国の政府関係機関向け	-	-	12,513
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	-	-	521,073
11	法人等向け	-	-	665,499
12	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-
13	上記以外	-	-	-
14	合計	-	-	1,340,381

【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)	28,223	179,352	83,954	236,529	5,767,133	4,283,658
2	現金(その他通貨)	28,031	12,685	1,989	16,695	4,272,487	3,548,906
3	国内ソブリン債	777	17,690	-	5,785	3,291,785	4,231,164
4	その他ソブリン債	457	-	-	-	3,183,624	3,465,288
5	政府関係機関債	1,228	-	-	-	534,613	762,526
6	社債	42,023	-	-	-	26,177	122,190
7	株式	15,232	1,983	38,280	37,109	569,946	264,842
8	その他担保	2,967	-	-	-	36,496	62,090
9	合計	118,942	211,711	124,224	296,119	17,682,264	16,740,668

(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	591,144	815,550
2	インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ	904,055	687,635
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	1,495,199	1,503,185
	公正価値		
7	プラスの公正価値(資産)	1,837	26,362
8	マイナスの公正価値(負債)	▲ 28,941	▲ 6,519

【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)		20,081
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。)	563,770	11,672
3	(i) 派生商品取引(上場以外)	310,627	6,697
4	(ii) 派生商品取引(上場)	81,632	1,632
5	(iii) レポ形式の取引	171,510	3,342
6	(iv) クロスプロダクト・ネットtingが承認された場合 のネットting・セット	-	-
7	分別管理されている当初証拠金	125,902	
8	分別管理されていない当初証拠金	15,135	300
9	事前拠出された清算基金	42,119	8,108
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tingが承認された場合 のネットting・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)	195,904	-	195,904
2	担保付住宅ローン	121,220	-	121,220
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	74,684	-	74,684
5	再証券化	-	-	-
6	ホールセール(合計)	429,890	-	429,890
7	事業法人向けローン	429,701	-	429,701
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	189	-	189
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)	1,121	-	1,121
2	担保付住宅ローン	1,121	-	1,121
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)	-	-	-
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	-	-	-

【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	621,526	621,526	621,526	191,824	429,701
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	500	500	500	500	-
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	3,580	3,580	3,580	3,580	-
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	189	189	189	-	189
エクスポージャーの額(算出方法別)						
6	内部格付手法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	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	625,606	625,606	625,606	195,904	429,701
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
9	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	189	189	189	-	189
信用リスク・アセットの額(算出方法別)						
10	内部格付手法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	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	125,850	125,850	125,850	39,910	85,940
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
13	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	2,362	2,362	2,362	-	2,362
所要自己資本の額(算出方法別)						
14	内部格付手法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	外部格付準拠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	10,068	10,068	10,068	3,192	6,875
16	標準的手法準拠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	-	-	-	-	-
17	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	189	189	189	-	189

		合計				
		資産譲渡型証券化取引(小計)			合成型 証券化取引 (小計)	証券化
		再証券化	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	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
9	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	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
13	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	外部格付準拠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	標準的手法準拠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	-	-	-	-	-
17	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	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
9	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	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
13	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	外部格付準拠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	標準的手法準拠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	-	-	-	-	-
17	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	712,082
2	株式リスク(一般市場リスク及び個別リスク)の額	186,072
3	外国為替リスクの額	111,775
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	10,122
9	合計	1,020,052

【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)

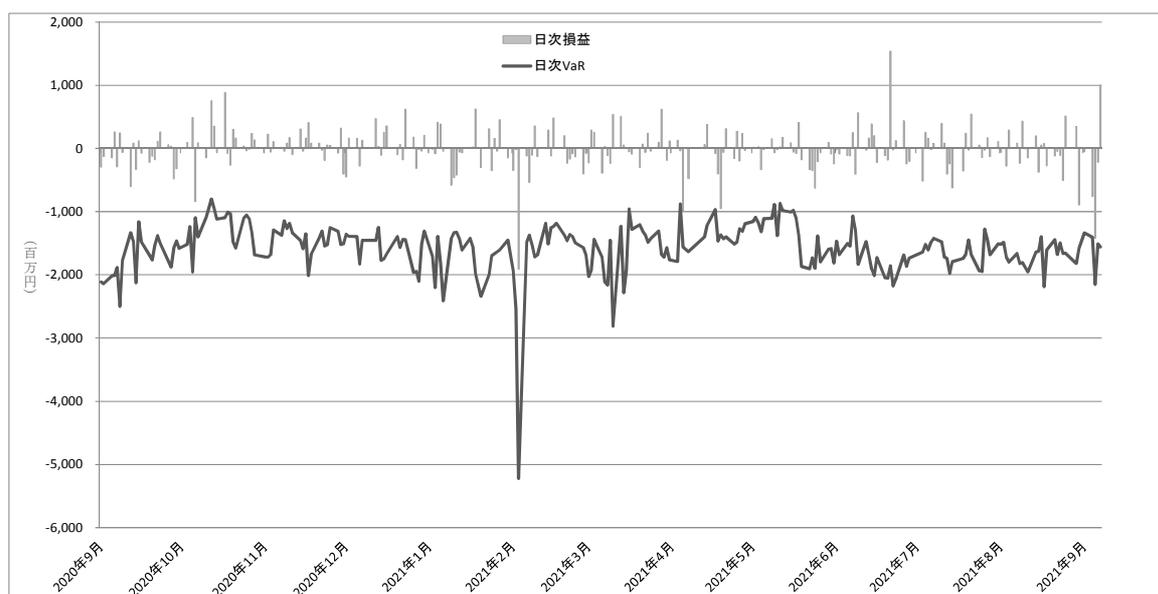
	前四半期末:2021年6月末 当四半期末:2021年9月末	バリュエーション・ アット・リスク	ストレス・ バリュエーション・ アット・リスク	追加的 リスク	包括的 リスク	その他	合計
1a	前四半期末におけるリスク・アセット	162,118	300,190	-	-		462,309
1b	前四半期末における連結自己資本規制上のリスク・アセット額への調整	2.14	2.35	-	-		2.27
1c	前四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	75,727	127,479	-	-		203,207
2	当四半期の 要因別の 変動額	リスク量の変動	▲ 14,988	▲ 19,656	-	-	▲ 34,644
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	60,739	107,823	-	-	
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	3.23	2.84	-	-		2.98
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	196,666	307,056	-	-		503,722

【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	20,204
2	平均値	4,177
3	最小値	1,500
4	期末	4,859
	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	16,136
6	平均値	6,510
7	最小値	1,980
8	期末	8,625
	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	
		2021年9月末	2020年9月末
1	上方パラレルシフト	3,339	4,277
2	下方パラレルシフト	19,576	21,436
3	スティープ化	1,447	562
4	フラット化	388	644
5	短期金利上昇	1,158	2,065
6	短期金利低下	12,274	12,782
7	最大値	19,576	21,436
		2021年9月末	2020年9月末
8	Tier1 資本の額	1,314,659	1,162,574

(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。

【CCyB1】カウンター・シクリカル・バッファー比率に係る国又は地域別の状況

(単位 百万円)

国又は地域	各金融当局が定める比率	カウンター・シクリカル・ バッファー比率の計算に 用いた当該国又は地域に 係る信用リスク・アセットの 額	カウンター・シクリカル ・バッファー比率	カウンター・シクリカル ・バッファーの額
香港	1.00%	15,473		
ルクセンブルク	0.50%	1,840		
小計		17,314		
合計		3,324,526	0.00%	321

(注)「カウンター・シクリカル・バッファー比率の計算に用いた当該国又は地域に係る信用リスク・アセットの額」については原則最終リスクベースでの算出を行っていますが、一部最終リスク国の把握が実態的に困難な資産については、記帳地を用いて算出を行っています。

■ 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	2021年9月末	2020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	11,256,916	11,866,680
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	21,446,862	21,934,491
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。)	1,867	12,365
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(△)	10,191,813	10,080,176
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(△)	189,415	202,818
3		オン・バランス資産の額 (イ)	11,067,501	11,663,862
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	459,256	481,299
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	808,356	619,133
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(△)	64,957	89,461
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	1,503,185	1,309,134
10		クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額から控除した額(△)	1,206,774	965,198
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	1,499,066	1,354,907
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	8,806,037	7,541,687
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	3,402,918	2,411,994
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	171,028	157,217
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)	5,574,147	5,286,910
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	167,071	209,798
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(△)	68,020	79,280
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	99,051	130,518
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	1,314,659	1,162,574
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	18,239,765	18,436,197
22		連結レバレッジ比率(ホ)/(ヘ)	7.20%	6.30%
日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率 (6)				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	18,239,765	18,436,197
		日本銀行に対する預け金の額	4,063,944	3,649,118
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーの額 (ヘ')	22,303,709	22,085,315
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率(ホ)/(ヘ')	5.89%	5.26%

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差異の原因は、分子の「資本の額」が152,085百万円増加したことによるものです。なお、「資本の額」の増加は「普通株式等 Tier1 資本の額」が114,546百万円増加したことと、「その他 Tier1 資本の額」が37,539百万円増加したことによるものです。

■ 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	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 (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	1,260,655 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類 (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)	永久劣後債務
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	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 (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	88 百万円	116 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)	永久劣後債務	永久劣後債務
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	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 (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	110 百万円	187 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)	永久劣後債務	永久劣後債務
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	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 (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	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 (4)		
	連結自己資本規制比率	244 百万円	336 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	2011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)	永久劣後債務	永久劣後債務
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	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 (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	394 百万円	866 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)	永久劣後債務	永久劣後債務
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	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 (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	335 百万円	1,043 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)	永久劣後債務	永久劣後債務
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	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 (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	361 百万円	910 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)	永久劣後債務	永久劣後債務
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	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 (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	366 百万円	457 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)	永久劣後債務	永久劣後債務
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	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 (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	393 百万円	832 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)	永久劣後債務	永久劣後債務
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	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 (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	429 百万円	757 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)	永久劣後債務	永久劣後債務
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	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 (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	501 百万円	202 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)	永久劣後債務	永久劣後債務
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	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 (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17回新株予約権	第18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	141 百万円	16 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)	2020年8月17日	2021年8月13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)	永久劣後債務	永久劣後債務
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	大和証券オフィス投資法人	サムティ・レジデンシャル投資法人
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	—	—
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	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	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 Tier2資本に係る基礎項目の額	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 Tier2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	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 Tier2資本に係る基礎項目の額	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 Tier2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	普通株式	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	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 40,616百万円 Tier2資本に係る基礎項目の額 9,556百万円	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 7,904万円 Tier2資本に係る基礎項目の額 1,859百万円
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	非支配株主持分	非支配株主持分
11	発行日 (7)	—	—
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	—	—
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)	永久劣後債務	永久劣後債務
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	JP350220AL30	JP350220BL39
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	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	その他Tier1資本に係る基礎項目の額	その他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	その他Tier1資本に係る基礎項目の額	その他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1回任意償還条項付無担保永久社債 (債務免除特約および劣後特約付)	第2回任意償還条項付無担保永久社債 (債務免除特約および劣後特約付)
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	124,700 百万円	25,000 百万円
9	額面総額(5)	125,000 百万円	25,000 百万円
10	表示される科目の区分(6)		
	連結貸借対照表	負債	負債
11	発行日(7)	2020年3月16日	2020年3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	有	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	2025年6月5日:元本全額償還	2030年6月5日:元本全額償還
	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)	税務事由又は資本事由:元本全額償還	税務事由又は資本事由:元本全額償還
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)	初回償還可能日以降の各利払日	初回償還可能日以降の各利払日
	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(11)	固定から変動	固定から変動
18	配当率又は利率(12)	2020年3月16日の翌日から2025年6月5日まで: 年1.20パーセント 2025年6月5日の翌日以降: 6か月ユーロ円LIBOR+1.40パーセント	2020年3月16日の翌日から2030年6月5日まで: 年1.39パーセント 2030年6月5日の翌日以降: 6か月ユーロ円LIBOR+1.50パーセント
19	配当等停止条項の有無(13)	有	有
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)	有	有
31	元本の削減が生じる場合(20)	・当社が報告又は公表する連結普通株式等Tier1比率が5.125%を下回った場合 ・内閣総理大臣が当社について、預金保険法第126条の2第1項第2号に定める措置である特定第二号措置を講ずる必要がある旨の認定を行った場合 ・当社について倒産手続の開始の決定等がなされた場合	・当社が報告又は公表する連結普通株式等Tier1比率が5.125%を下回った場合 ・内閣総理大臣が当社について、預金保険法第126条の2第1項第2号に定める措置である特定第二号措置を講ずる必要がある旨の認定を行った場合 ・当社について倒産手続の開始の決定等がなされた場合
32	元本の削減が生じる範囲(21)	全部削減又は一部削減	全部削減又は一部削減
33	元本回復特約の有無(22)	有	有
34	その概要	元金回復がなされた直後においても十分に高い水準の連結普通株式等Tier1比率が維持されることについて、あらかじめ金融庁その他の監督当局の確認を受けたうえで、当社が元金の支払義務の免除の効力を将来に向かって消滅させることを決定する場合	元金回復がなされた直後においても十分に高い水準の連結普通株式等Tier1比率が維持されることについて、あらかじめ金融庁その他の監督当局の確認を受けたうえで、当社が元金の支払義務の免除の効力を将来に向かって消滅させることを決定する場合
34a	劣後性の手段(23)	契約上の劣後	契約上の劣後
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)	—	—

以上