

2025年1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 代表執行役社長 荻野 明彦

(コード番号 8601 東証プライム・名証プレミア)

## 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（2024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（2024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		2024年 9月末	2024年 6月末	2024年 3月末	2023年 12月末	2023年 9月末
資本						
1	普通株式等Tier1 資本の額	1,274,461	1,367,678	1,331,138	1,299,914	1,308,028
2	Tier1資本の額	1,462,684	1,554,875	1,520,820	1,489,647	1,495,881
3	総自己資本の額	1,470,667	1,557,238	1,529,866	1,498,996	1,502,097
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	7,189,880	7,426,777	7,087,470	6,691,815	6,789,921
自己資本比率						
5	連結普通株式等 Tier1比率	17.72%	18.41%	18.78%	19.42%	19.26%
6	連結Tier1比率	20.34%	20.93%	21.45%	22.26%	22.03%
7	連結総自己資本 比率	20.45%	20.96%	21.58%	22.40%	22.12%
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	0.11%	0.10%	0.08%	0.08%	0.08%
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	3.11%	3.10%	3.08%	3.08%	3.08%
12	連結資本バッファー 比率	12.45%	12.96%	13.58%	14.40%	14.12%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャー の額	26,665,976	28,623,154	24,461,756	24,439,442	27,268,928
14	連結レバレッジ比率	5.48%	5.43%	6.21%	6.09%	5.48%

## ■ 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	1,329,146	
1a	うち、資本金及び資本剰余金の額	481,175	(i), (j)
2	うち、利益剰余金の額	1,003,959	(k)
1c	うち、自己株式の額 (Δ)	116,501	(l), (m)
26	うち、社外流出予定額 (Δ)	39,488	
	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	6,265	(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	187,824	(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)	1,523,236	
	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	169,130	
8	うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	55,190	(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	113,939	(f)
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	326	(d), (h)
11	繰延ヘッジ損益の額	616	(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	690	
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	109	(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	3,586	(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	74,314	
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	74,314	
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)	248,775	
	普通株式等Tier1資本		
29	普通株式等Tier1資本の額 ((イ) - (ロ)) (ハ)	1,274,461	

(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	148,500
		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	40,125 (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)	188,625
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	402 (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	-
43		その他Tier1資本に係る調整項目の額 (ホ)	402
その他Tier1資本			
44		その他Tier1資本の額 ((二) - (ホ)) (ヘ)	188,223
Tier1資本			
45		Tier1資本の額 ((ハ) + (ヘ)) (ト)	1,462,684
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	9,441 (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)	9,441

(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	1,458	(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)	1,458	
Tier2資本			
58	Tier2資本の額 ((チ) - (リ)) (ヌ)	7,982	
総自己資本			
59	総自己資本の額 ((ト) + (ヌ)) (ル)	1,470,667	
リスク・アセット (5)			
60	リスク・アセットの額の合計額 (ヲ)	7,189,880	
連結自己資本規制比率			
61	連結普通株式等Tier1比率 ((ハ) / (ヲ))	17.72%	
62	連結Tier1比率 ((ト) / (ヲ))	20.34%	
63	連結総自己資本規制比率 ((ル) / (ヲ))	20.45%	
64	最低連結資本バッファ比率	3.11%	
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	0.11%	
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	12.45%	
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	135,236	(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	134,877	(a),(b),(c),(g)
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	7,009	(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

133 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
大和エネルギー・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
大和証券リアルティ株式会社	不動産関連業
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
大和インベスター・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	709	448
DMS Ltd.	システムソリューション、リサーチ、コンサルティング	239	220
Asian Energy Investments Pte., Ltd.	投資運用業、投資助言・代理業	8	6
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	342	336
Daiwa Corporate Investment Asia Ltd.	投資業	236	216
アイ・エル・シー株式会社	投資運用業、投資助言・代理業	406	▲ 664

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	3,863,043	3,864,234	
預託金	591,648	591,648	
受取手形、売掛金及び契約資産	30,047	30,047	
有価証券 (a)	1,519,440	1,519,440	8, 18, 39, 54, 72, 73
トレーディング商品 (b)	8,248,335	8,248,335	16, 18, 39, 54, 72, 73
営業投資有価証券 (c)	140,127	140,127	18, 39, 54, 72, 73
投資損失引当金	▲ 50	▲ 50	
営業貸付金	2,920,165	2,920,165	
仕掛品	1,157	1,157	
信用取引資産	159,573	159,573	
有価証券担保貸付金	13,535,536	13,535,536	
立替金	26,834	26,834	
短期貸付金	502	502	
未収収益	99,131	99,244	
繰延税金資産 (d)	-	-	10, 75
その他の流動資産	870,978	871,396	
貸倒引当金	▲ 9,256	▲ 9,256	
流動資産計	31,997,215	31,998,938	
固定資産			
有形固定資産	923,083	923,104	
無形固定資産	129,723	129,774	
のれん (e)	16,250	16,250	8
のれん以外 (f)	113,472	113,523	9
投資その他の資産	644,853	644,527	
投資有価証券 (g)	597,416	597,048	8, 18, 39, 54, 72, 73
繰延税金資産 (h)	7,326	7,335	10, 75
上記以外	40,111	40,142	
固定資産計	1,697,660	1,697,407	
繰延資産計	-	-	
資産の部合計	33,694,875	33,696,345	

(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	8,383	8,383	
トレーディング商品	5,670,339	5,670,339	
約定見返勘定	212,477	212,477	
信用取引負債	42,996	42,996	
有価証券担保借入金	14,713,686	14,713,686	
銀行業における預金	4,200,976	4,200,976	
預り金	734,899	734,907	
受入保証金	526,857	526,857	
短期借入金	1,421,550	1,422,550	
コマーシャルペーパー	521,400	521,400	
1年内償還予定の社債	310,672	310,672	
未払法人税等	24,871	24,871	
繰延税金負債	-	-	
賞与引当金	33,744	33,744	
その他の流動負債	133,120	133,339	
固定負債			
社債	1,175,625	1,175,625	
長期借入金	2,002,815	2,002,815	
繰延税金負債	43,733	43,733	
退職給付に係る負債	43,498	43,498	
訴訟損失引当金	299	299	
負ののれん	-	-	
その他の固定負債	47,833	47,983	
特別法上の準備金	5,643	5,643	
負債の部合計	31,875,426	31,876,804	
純資産の部			
株主資本			
資本金 (i)	247,397	247,397	1a
資本剰余金 (j)	233,778	233,778	1a
利益剰余金 (k)	1,004,165	1,003,959	2
自己株式 (l)	▲ 116,567	▲ 116,567	1c
自己株式申込証拠金 (m)	66	66	1c
株主資本合計	1,368,840	1,368,634	
その他の包括利益累計額			
その他有価証券評価差額金	59,976	59,976	
繰延ヘッジ損益 (n)	2,181	2,181	11
為替換算調整勘定	125,508	125,688	
退職給付に係る調整累計額	▲ 22	▲ 22	
その他の包括利益累計額 (o)	187,644	187,824	3
新株予約権 (p)	6,265	6,265	1b
非支配株主持分 (q)	256,699	256,816	34-35, 48-49
純資産の部合計	1,819,449	1,819,540	

■ 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)	549,913
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)	35,197
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%)	12,800
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%)	12
合計	597,925

### 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	
		2024年 9月末	2023年 9月末	2024年 9月末	2023年 9月末
1	信用リスク	2,383,617	2,384,652	190,689	190,772
2	うち、標準的手法適用分	1,237,232	1,189,539	98,978	95,163
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	1,146,384	1,195,113	91,710	95,609
4	カウンターパーティ信用リスク	1,257,861	1,408,430	100,628	112,674
5	うち、SA-CCR適用分	358,750	490,499	28,700	39,239
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	375,723	505,769	30,057	40,461
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	30,189	36,842	2,415	2,947
	その他	493,198	375,319	39,455	30,025
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 (ルック・スルー方式)	338,354	304,101	27,068	24,328
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)	43,890	43,189	3,511	3,455
	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%)	32,002	-	2,560	-
	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%)	160	8,400	12	672
11	未決済取引	6,030	254	482	20
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	226,352	182,457	18,108	14,596
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	191,306	182,457	15,304	14,596
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	35,045	-	2,803	-
16	マーケット・リスク	1,299,267	1,111,238	103,941	88,899
17	うち、標準的方式適用分	862,069	779,860	68,965	62,388
18	うち、内部モデル方式適用分	437,197	331,377	34,975	26,510
19	オペレーショナル・リスク	1,247,549	1,105,187	99,803	88,415
20	うち、基礎的手法適用分	1,247,549	1,105,187	99,803	88,415
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	354,793	242,008	28,383	19,360
	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	7,189,880	6,789,921	575,190	543,193

(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	
		2024年 9月末	2024年 6月末	2024年 9月末	2024年 6月末
1	信用リスク	2,383,617	2,449,518	190,689	195,961
2	うち、標準的手法適用分	1,237,232	1,292,144	98,978	103,371
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	1,146,384	1,157,374	91,710	92,589
4	カウンターパーティ信用リスク	1,257,861	1,616,793	100,628	129,343
5	うち、SA-CCR適用分	358,750	533,198	28,700	42,655
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	375,723	537,569	30,057	43,005
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	30,189	33,855	2,415	2,708
	その他	493,198	512,169	39,455	40,973
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 (ルック・スルー方式)	338,354	314,808	27,068	25,184
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anded方式)	43,890	60,786	3,511	4,862
	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%)	32,002	34,692	2,560	2,775
	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%)	160	181	12	14
11	未決済取引	6,030	244	482	19
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	226,352	243,388	18,108	19,471
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	191,306	207,013	15,304	16,561
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	35,045	36,375	2,803	2,910
16	マーケット・リスク	1,299,267	1,256,196	103,941	100,495
17	うち、標準的方式適用分	862,069	868,053	68,965	69,444
18	うち、内部モデル方式適用分	437,197	388,142	34,975	31,051
19	オペレーショナル・リスク	1,247,549	1,183,218	99,803	94,657
20	うち、基礎的手法適用分	1,247,549	1,183,218	99,803	94,657
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	354,793	266,950	28,383	21,356
	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	7,189,880	7,426,777	575,190	594,142

## 【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	28,000	2,072,950	11,321	2,089,629
2	有価証券(うち負債性のもの)	-	1,298,775	-	1,298,775
3	その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)	22,471	4,027,445	956	4,048,960
4	オン・バランスシートの資産の合計(1+2+3)	50,471	7,399,171	12,277	7,437,364
オフ・バランスシートの資産					
5	支払承諾等	-	56,987	-	56,987
6	コミットメント等	-	-	-	-
7	オフ・バランスシートの資産の合計(5+6)	-	56,987	-	56,987
合計					
8	合計(4+7)	50,471	7,456,158	12,277	7,494,352

(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:2024年3月末 当中間期末:2024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	56,673	
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	非デフォルト状態へ復帰した額	-
4		償却された額	-
5		その他の変動額	▲ 6,201
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)	50,471	

(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	1,409,909	679,719	298,111	381,608	-
2	有価証券(負債性のもの)	1,179,994	118,780	-	118,780	-
3	その他オン・バランスシートの資産(負債性のもの)	4,048,953	6	6	-	-
4	合計(1+2+3)	6,638,857	798,507	298,117	500,389	-
5	うちデフォルトしたもの	47,517	-	-	-	-

【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	4,302,640	-	4,302,640	-	-	0.00%
3 外国の中央政府及び中央銀行向け	404,580	-	404,580	-	22	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	61,823	-	61,823	-	-	0.00%
6 外国の中央政府等以外の公共部門 向け	7,997	-	7,997	-	1,634	20.44%
7 国際開発銀行向け	11,926	-	11,926	-	-	0.00%
8 地方公共団体金融機構向け	15,748	-	15,748	-	3,144	19.97%
9 我が国の政府関係機関向け	627,791	-	627,791	-	30,868	4.92%
10 地方三公社向け	10	-	10	-	2	20.00%
11 金融機関及び第一種金融商品取引 業者向け	1,210,076	-	1,210,076	-	244,480	20.20%
12 法人等向け	1,111,111	14,072	812,993	14,072	551,498	66.68%
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	15,480	14,966	15,480	14,966	30,447	100.00%
16 三月以上延滞等 (抵当権付住宅ローンを除く。)	47,517	-	47,517	-	71,272	149.99%
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。)	300,111	6,501	300,111	3,750	303,862	100.00%
22 合計	8,116,818	35,540	7,818,700	32,789	1,237,232	15.76%

【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		4,302,640	-	-	-	-	-
3 外国の中央政府及び中央銀行向け		404,542	-	5	-	24	-
4 国際決済銀行等向け		-	-	-	-	-	-
5 我が国の地方公共団体向け		61,823	-	-	-	-	-
6 外国の中央政府等以外の公共部門向け		-	-	7,953	-	-	-
7 国際開発銀行向け		11,926	-	-	-	-	-
8 地方公共団体金融機構向け		-	54	15,694	-	-	-
9 我が国の政府関係機関向け		330,440	286,012	11,338	-	-	-
10 地方三公社向け		-	-	10	-	-	-
11 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け		-	15,096	1,189,742	-	430	-
12 法人等向け		150,049	-	77,006	-	127,825	-
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。)		-	-	-	-	4	-
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		5,261,423	301,163	1,301,750	-	128,286	-



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)				
		100%	150%	250%	1250%	合計
1 現金		-	-	-	-	-
2 日本国政府及び日本銀行向け		-	-	-	-	4,302,640
3 外国の中央政府及び中央銀行向け		8	-	-	-	404,580
4 国際決済銀行等向け		-	-	-	-	-
5 我が国の地方公共団体向け		-	-	-	-	61,823
6 外国の中央政府等以外の公共部門向け		44	-	-	-	7,997
7 国際開発銀行向け		-	-	-	-	11,926
8 地方公共団体金融機構向け		-	-	-	-	15,748
9 我が国の政府関係機関向け		-	-	-	-	627,791
10 地方三公社向け		-	-	-	-	10
11 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け		4,806	-	-	-	1,210,076
12 法人等向け		472,184	-	-	-	827,066
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		30,447	-	-	-	30,447
16 三月以上延滞等 (抵当権付住宅ローンを除く。)		-	47,513	-	-	47,517
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。)		303,862	-	-	0	303,862
22 合計		811,353	47,513	-	0	7,851,490

【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 $\alpha$	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	178,093	261,621		1.4	615,600	358,750
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					1,762,614	493,198
5	エクスポージャー変動推計モデル						-
6	合計						851,948

【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	546,796	375,723
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	546,796	375,723

【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	923,478	-	-
2	外国の中央政府及び中央銀行向け	5,333	-	5,628
3	国際決済銀行等向け	94,480	-	-
4	我が国の地方公共団体向け	1,569	-	-
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	-	62,220
6	国際開発銀行向け	10,571	-	-
7	地方公共団体金融機構向け	-	-	2,799
8	我が国の政府関係機関向け	-	-	25,452
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	-	-	476,142
11	法人等向け	-	-	17,002
12	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-
13	上記以外	-	-	-
14	合計	1,035,432	-	589,245

(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	19	-	-
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	1,800	-	-
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	7,781	-	-
11	法人等向け	30,320	-	712,570
12	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-
13	上記以外	-	-	-
14	合計	39,921	-	712,570

## 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	-	-	923,478
2	外国の中央政府及び中央銀行向け	-	-	10,980
3	国際決済銀行等向け	-	-	94,480
4	我が国の地方公共団体向け	-	-	1,569
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	-	64,020
6	国際開発銀行向け	-	-	10,571
7	地方公共団体金融機構向け	-	-	2,799
8	我が国の政府関係機関向け	-	-	25,452
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	-	-	483,923
11	法人等向け	1,046	-	760,938
12	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-
13	上記以外	-	-	-
14	合計	1,046	-	2,378,215

## 【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)	25,647	255,251	50,052	317,311	7,987,538	7,461,993
2	現金(その他通貨)	913	69,572	11,206	5,085	8,607,413	7,141,896
3	国内ソブリン債	14,391	353,812	18,984	-	6,941,794	7,130,322
4	その他ソブリン債	15,018	2,913	-	-	5,379,319	5,732,013
5	政府関係機関債	1,055	101,031	-	-	1,072,653	3,057,805
6	社債	59,037	323,627	-	-	136,080	269,108
7	株式	22,384	297	-	17,577	586,587	457,187
8	その他担保	2,315	-	-	-	10,442	1,496,029
9	合計	140,763	1,106,506	80,243	339,974	30,721,830	32,746,355

(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	619,888	904,478
2	インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ	2,769,031	2,665,552
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	3,388,919	3,570,030
	公正価値		
7	プラスの公正価値(資産)	1,699	58,372
8	マイナスの公正価値(負債)	▲ 56,172	▲ 3,250

【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)		30,189
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。)	708,221	14,170
3	(i) 派生商品取引(上場以外)	243,223	4,940
4	(ii) 派生商品取引(上場)	117,674	2,353
5	(iii) レポ形式の取引	347,324	6,876
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	82,143	
8	分別管理されていない当初証拠金	28,415	568
9	事前拠出された清算基金	23,343	15,450
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)	401,194	-	401,194
2	担保付住宅ローン	179,592	-	179,592
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	221,602	-	221,602
5	再証券化	-	-	-
6	ホールセール(合計)	566,416	-	566,416
7	事業法人向けローン	545,883	-	545,883
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	20,533	-	20,533
10	その他のホールセール	-	-	-
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)	589	-	589
2	担保付住宅ローン	589	-	589
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	964,807	964,807	964,807	398,391	566,416
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
4	100%超125%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
5	125%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	2,803	2,803	2,803	2,803	-
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	964,807	964,807	964,807	398,391	566,416
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	125%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	2,803	2,803	2,803	2,803	-
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	191,306	191,306	191,306	78,060	113,245
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	125%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	35,045	35,045	35,045	35,045	-
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	15,304	15,304	15,304	6,244	9,059
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	125%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	2,803	2,803	2,803	2,803	-

		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	567,146
2	株式リスク(一般市場リスク及び個別リスク)の額	76,010
3	外国為替リスクの額	215,059
4	コモディティ・リスクの額	379
	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	3,473
9	合計	862,069

【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)

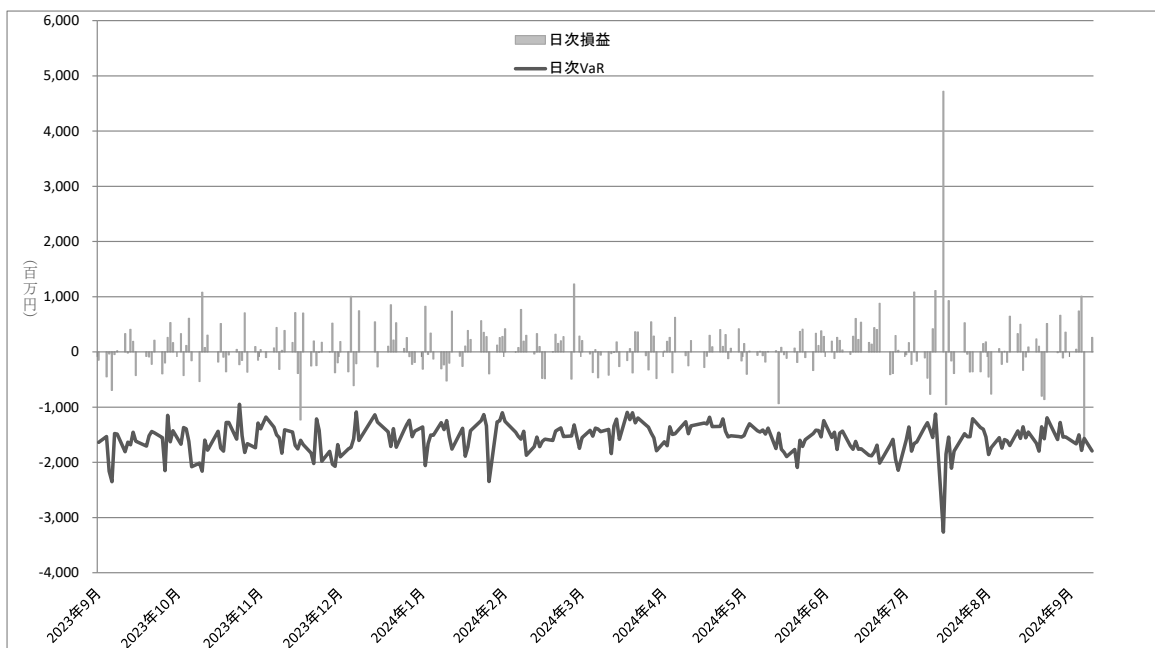
	前四半期末:2024年6月末 当四半期末:2024年9月末	バリュー・ アット・リス ク	ストレス・ バリュー・ アット・リス ク	追加的 リスク	包括的 リスク	その他	合計
1a	前四半期末におけるリスク・アセット	148,499	239,643	-	-		388,142
1b	前四半期末における連結自己資本規制上 のリスク・アセット額への調整	3.78	5.45	-	-		4.66
1c	前四半期末の算出基準日における内部モ デル方式の算出額	39,280	43,927	-	-		83,208
2	当四半期の 要因別の 変動額	リスク量の変動	10,148	87,634	-	-	97,783
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	49,429	131,562	-	-	
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	3.09	2.15	-	-		2.41
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	153,221	283,976	-	-		437,197

【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	6,438
2	平均値	3,543
3	最小値	1,380
4	期末	3,884
	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	11,113
6	平均値	6,611
7	最小値	2,063
8	期末	10,452
	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	
		2024年9月末	2023年9月末
1	上方パラレルシフト	8,343	11,392
2	下方パラレルシフト	20,114	23,532
3	スティープ化	10,375	10,749
4	フラット化	454	320
5	短期金利上昇	1,033	1,910
6	短期金利低下	13,420	14,075
7	最大値	20,114	23,532
		2024年9月末	2023年9月末
8	Tier1 資本の額	1,462,684	1,495,881

(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
オーストラリア	1.00%	78,999		
ベルギー	0.50%	5,496		
フランス	1.00%	524		
ドイツ	0.75%	18		
香港	1.00%	10,555		
韓国	1.00%	42,633		
ルクセンブルク	0.50%	43,230		
オランダ	2.00%	16,709		
英国	2.00%	120,749		
小計		318,917		
合計		3,744,061	0.11%	8,296

(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	2024年9月末	2023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	14,494,641	15,773,600
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	30,614,256	29,775,677
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。)	1,470	1,104
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(△)	16,121,085	14,003,181
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(△)	247,870	177,281
3		オン・バランス資産の額 (イ)	14,246,771	15,596,319
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	615,788	1,105,777
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	529,214	790,498
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(△)	71,050	34,968
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	3,570,030	3,039,000
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(△)	3,175,731	2,630,244
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	1,468,251	2,270,063
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	14,638,853	12,401,939
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	4,042,065	3,327,344
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	228,014	211,029
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)	10,824,802	9,285,624
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	180,011	166,722
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(△)	53,859	49,800
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	126,152	116,922
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	1,462,684	1,495,881
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	26,665,976	27,268,928
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	5.48%	5.48%
		適用する所要連結レバレッジ比率	3.15%	3.00%
		適用する所要連結レバレッジ・バッファ比率	-	-
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)	28,623,154	27,268,928
		日本銀行に対する預け金の額	3,054,098	3,648,989
		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')	31,677,252	30,917,917
		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'))	4.90%	4.83%

### 2. 前中間事業年度の連結レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた原因

当中間事業年度と前中間事業年度の連結レバレッジ比率の差異はありません。

## ■ 自己資本調達手段に関する契約内容の概要

### 【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	1,329,146 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)	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	34 百万円	47 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	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	55 百万円	112 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	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	162 百万円	264 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	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	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 (4)		
	連結自己資本規制比率	336 百万円	293 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	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	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	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 (4)		
	連結自己資本規制比率	329 百万円	346 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	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	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 (4)		
	連結自己資本規制比率	166 百万円	375 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	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	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 (4)		
	連結自己資本規制比率	389 百万円	407 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	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	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 (4)		
	連結自己資本規制比率	492 百万円	340 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8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	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16回新株予約権	第17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	277 百万円	505 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)	2019年8月15日	2020年8月17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)	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18回新株予約権	第19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	311 百万円	420 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)	2021年8月13日	2022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)	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20回新株予約権	第21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	512百万円	85百万円
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)	2023年8月15日	2024年8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 30,712百万円 Tier2資本に係る基礎項目の額 7,226百万円	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 9,412百万円 Tier2資本に係る基礎項目の額 2,214百万円
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類 (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外部TLAC調達手段のうち、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類 (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	123,500 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