

2020年1月31日

各位

会社名 株式会社大和証券グループ本社
代表者名 執行役社長 中田 誠司
(コード番号 8601 東証・名証(第1部))

連結自己資本規制比率及び連結レバレッジ比率に関するお知らせ

－ 経営の健全性の状況(2019年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(2019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
5.	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		2019年 9月末	2019年 6月末	2019年 3月末	2018年 12月末	2018年 9月末
資本						
1	普通株式等Tier1 資本の額	1,061,011	1,074,541	1,086,889	1,081,295	1,105,298
2	Tier1資本の額	1,061,011	1,074,541	1,086,889	1,081,295	1,105,298
3	総自己資本の額	1,061,011	1,074,541	1,086,889	1,081,295	1,105,298
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	5,572,157	5,089,921	5,020,849	4,988,639	5,307,882
自己資本比率						
5	連結普通株式等 Tier1比率	19.04%	21.11%	21.64%	21.67%	20.82%
6	連結Tier1比率	19.04%	21.11%	21.64%	21.67%	20.82%
7	連結総自己資本 比率	19.04%	21.11%	21.64%	21.67%	20.82%
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%	1.87%	1.87%
9	カウンター・シクリカ ル・バッファー比率	0.03%	0.02%	0.02%	0.02%	0.01%
10	G-SIB/D-SIBバッ ファー比率	0.50%	0.50%	0.50%	0.37%	0.37%
11	最低連結資本バッ ファー比率	3.03%	3.02%	3.02%	2.27%	2.26%
12	連結資本バッファー 比率	11.04%	13.11%	13.64%	13.67%	12.82%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャー の額	19,417,404	19,816,310	18,674,804	20,092,466	19,916,960
14	連結レバレッジ比率	5.46%	5.42%	5.82%	5.38%	5.54%

■ 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	1,191,615	
1a	うち、資本金及び資本剰余金の額	478,030	(i), (j)
2	うち、利益剰余金の額	824,657	(k)
1c	うち、自己株式の額 (△)	94,004	(l), (m)
26	うち、社外流出予定額(△)	17,067	
	うち、上記以外に該当するものの額	-	
1b	普通株式に係る新株予約権の額	8,721	(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	30,504	(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)	1,230,840	
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	136,460	
8	うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	31,021	(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	105,439	(f)
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	390	(d), (h)
11	繰延ヘッジ損益の額	▲ 171	(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	-	
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	177	(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	15,924	(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	17,047	
28	普通株式等Tier1資本に係る調整項目の額 (ロ)	169,829	
普通株式等Tier1資本			
29	普通株式等Tier1資本の額 ((イ) - (ロ)) (ハ)	1,061,011	

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目	当最終指定親会社 四半期末	別紙様式第八号 (CC2)の参照項目
その他Tier1資本に係る基礎項目 (3)			
30	31a	その他Tier1資本調達手段に係る株主資本の額及びその内訳	-
	31b	その他Tier1資本調達手段に係る新株予約権の額	-
	32	その他Tier1資本調達手段に係る負債の額	-
		特別目的会社等の発行するその他Tier1資本調達手段の額	-
34-35		その他Tier1資本に係る調整後非支配株主持分等の額	6,512 (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)	6,512
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	5,490 (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	18,070
43		その他Tier1資本に係る調整項目の額 (ホ)	23,560
その他Tier1資本			
44		その他Tier1資本の額 ((二) - (ホ)) (ヘ)	-
Tier1資本			
45		Tier1資本の額 ((ハ) + (ヘ)) (ト)	1,061,011
Tier2資本に係る基礎項目 (4)			
46		Tier2資本調達手段に係る株主資本の額及びその内訳	-
		Tier2資本調達手段に係る新株予約権の額	-
		Tier2資本調達手段に係る負債の額	-
		特別目的会社等の発行するTier2資本調達手段の額	-
48-49		Tier2資本に係る調整後非支配株主持分等の額	1,532 (q)
47+49		適格旧Tier2資本調達手段の額のうちTier2資本に係る基礎項目の額に含まれる額	-
47		うち、最終指定親会社及び最終指定親会社の特別目的会社等の発行する資本調達手段の額	-
49		うち、最終指定親会社の連結子法人等(最終指定親会社の特別目的会社等を除く。)の発行する資本調達手段の額	-
50		一般貸倒引当金Tier2算入額及び適格引当金Tier2算入額の合計額	-
50a		うち、一般貸倒引当金Tier2算入額	-
50b		うち、適格引当金Tier2算入額	-
51		Tier2資本に係る基礎項目の額 (チ)	1,532

(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	19,281	(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	321	
57	Tier2資本に係る調整項目の額 (リ)	19,602	
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)	1,061,011	
リスク・アセット (5)			
60	リスク・アセットの額の合計額 (ヲ)	5,572,157	
連結自己資本規制比率			
61	連結普通株式等Tier1比率 ((ハ) / (ヲ))	19.04%	
62	連結Tier1比率 ((ト) / (ヲ))	19.04%	
63	連結総自己資本規制比率 ((ル) / (ヲ))	19.04%	
64	最低連結資本バッファ比率	3.03%	
65	うち、資本保全バッファ比率	2.50%	
66	うち、カウンター・シクリカル・バッファ比率	0.03%	
67	うち、G-SIB/D-SIB バッファ比率	0.50%	
68	連結資本バッファ比率	11.04%	
調整項目に係る参考事項 (6)			
72	少数出資金融機関等の対象資本等調達手段に係る調整項目不算入額	109,398	(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	61,272	(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	9,719	(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

相違点はありません。

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

連結子会社の数

62 社

主要な連結子会社の名称	主要な業務の内容
大和証券株式会社	有価証券関連業、投資助言・代理業
大和証券投資信託委託株式会社	投資運用業、投資助言・代理業
株式会社大和総研ホールディングス	子会社の統合・管理
株式会社大和証券ビジネスセンター	事務代行業
大和プロパティ株式会社	不動産賃貸業
株式会社大和ネクスト銀行	銀行業
株式会社大和総研	情報サービス業
株式会社大和総研ビジネス・イノベーション	情報サービス業
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
大和証券キャピタル・マーケッツ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・マーケッツ香港リミテッド	有価証券関連業
大和証券キャピタル・マーケッツ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・マーケッツ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・マーケッツアメリカInc.	有価証券関連業

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

比例連結の方法を適用している金融業務を営む関連法人等はありません。

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

該当ありません。

ホ)会社グループ内の資金及び自己資本の移動に係る制限等の概要

グループ内の資金及び自己資本の移動に係る特別な制限等はありません。

5. 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	4,379,897	4,379,897	
預託金	348,062	348,062	
受取手形及び売掛金	17,116	17,116	
有価証券 (a)	839,550	839,550	18, 39, 54, 72, 73
トレーディング商品 (b)	8,186,322	8,186,322	16, 18, 39, 54, 72, 73
約定見返勘定	-	-	
営業投資有価証券 (c)	153,555	153,555	18, 39, 54, 72, 73
投資損失引当金	▲ 181	▲ 181	
営業貸付金	1,551,634	1,551,634	
仕掛品	1,079	1,079	
信用取引資産	187,860	187,860	
有価証券担保貸付金	5,613,075	5,613,075	
立替金	18,106	18,106	
短期貸付金	371	371	
未収収益	36,960	36,960	
繰延税金資産 (d)	-	-	10, 75
その他の流動資産	550,189	550,189	
貸倒引当金	▲ 339	▲ 339	
流動資産計	21,883,263	21,883,263	
固定資産			
有形固定資産	284,165	284,165	
無形固定資産	119,612	119,612	
のれん (e)	14,173	14,173	8
のれん以外 (f)	105,439	105,439	9
投資その他の資産	522,153	522,153	
投資有価証券 (g)	457,666	457,666	8, 18, 39, 54, 72, 73
繰延税金資産 (h)	10,110	10,110	10, 75
上記以外	54,376	54,376	
固定資産計	925,931	925,931	
繰延資産計	52	52	
資産の部合計	22,809,247	22,809,247	

(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	7,066	7,066	
トレーディング商品	5,477,973	5,477,973	
約定見返勘定	418,459	418,459	
信用取引負債	73,570	73,570	
有価証券担保借入金	6,290,055	6,290,055	
銀行業における預金	4,001,141	4,001,141	
預り金	335,991	335,991	
受入保証金	436,176	436,176	
短期借入金	1,177,524	1,177,524	
コマーシャルペーパー	206,000	206,000	
1年内償還予定の社債	325,016	325,016	
未払法人税等	5,671	5,671	
繰延税金負債	-	-	
賞与引当金	18,857	18,857	
その他の流動負債	122,969	122,969	
固定負債			
社債	1,203,587	1,203,587	
長期借入金	1,314,917	1,314,917	
繰延税金負債	6,198	6,198	
退職給付に係る負債	43,866	43,866	
訴訟損失引当金	24,464	24,464	
負ののれん	-	-	
その他の固定負債	30,182	30,182	
特別法上の準備金	3,938	3,938	
負債の部合計	21,523,629	21,523,629	
純資産の部			
株主資本			
資本金 (i)	247,397	247,397	1a
資本剰余金 (j)	230,633	230,633	1a
利益剰余金 (k)	824,657	824,657	2
自己株式 (l)	▲ 94,009	▲ 94,009	1c
自己株式申込証拠金 (m)	4	4	1c
株主資本合計	1,208,682	1,208,682	
その他の包括利益累計額			
その他有価証券評価差額金	45,605	45,605	
繰延ヘッジ損益 (n)	▲ 8,588	▲ 8,588	11
為替換算調整勘定	▲ 6,512	▲ 6,512	
その他の包括利益累計額 (o)	30,504	30,504	3
新株予約権 (p)	8,721	8,721	1b
非支配株主持分 (q)	37,709	37,709	34-35, 48-49
純資産の部合計	1,285,618	1,285,618	

■ 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)	746,180
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(マンドレート方式)	75,763
リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式250%)	-
リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(蓋然性方式400%)	-
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%)	107
合計	822,051

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	
		2019年 9月末	2018年 9月末	2019年 9月末	2018年 9月末
1	信用リスク	1,001,700	813,622	80,135	65,089
2	うち、標準的手法適用分	684,005	632,744	54,720	50,619
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	317,695	180,877	25,415	14,470
4	カウンターパーティ信用リスク	982,493	1,244,837	78,599	99,587
5	うち、SA-CCR適用分	326,211	-	26,096	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	-	316,493	-	25,319
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	329,919	537,603	26,393	43,008
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	16,191	32,038	1,295	2,563
	その他	310,170	358,702	24,813	28,696
7	マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	-	-	-	-
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）	482,343	394,470	38,587	31,557
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（マンドレート方式）	75,768	-	6,061	-
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式250%）	-	-	-	-
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式400%）	-	-	-	-
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（フォールバック方式1250%）	1,345	-	107	-
11	未決済取引	2,067	165	165	13
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー	127,643	148,437	10,211	11,875
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	127,643	148,437	10,211	11,875
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	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	1,766,164	1,556,021	141,293	124,481
17	うち、標準的方式適用分	899,319	940,387	71,945	75,230
18	うち、内部モデル方式適用分	866,845	615,634	69,347	49,250
19	オペレーショナル・リスク	955,149	992,187	76,411	79,375
20	うち、基礎的手法適用分	955,149	992,187	76,411	79,375
21	うち、粗利益配分手法適用分	-	-	-	-
22	うち、先進的計測手法適用分	-	-	-	-
23	特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー	177,480	158,140	14,198	12,651
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	-	-	-	-
24	フロア調整	-	-	-	-
25	合計	5,572,157	5,307,882	445,772	424,630

(単位 百万円)

国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2019年 9月末	2019年 6月末	2019年 9月末	2019年 6月末
1	信用リスク	1,001,700	803,669	80,135	64,293
2	うち、標準的手法適用分	684,005	584,394	54,720	46,751
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	317,695	219,274	25,415	17,541
4	カウンターパーティ信用リスク	982,493	963,210	78,599	77,056
5	うち、SA-CCR適用分	326,211	324,115	26,096	25,929
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	329,919	331,304	26,393	26,504
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	16,191	15,949	1,295	1,275
	その他	310,170	291,841	24,813	23,347
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）	482,343	426,623	38,587	34,129
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）	75,768	71,764	6,061	5,741
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式250%）	-	-	-	-
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（蓋然性方式400%）	-	-	-	-
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（フォールバック方式1250%）	1,345	1,549	107	123
11	未決済取引	2,067	237	165	18
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	127,643	149,718	10,211	11,977
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	127,643	149,718	10,211	11,977
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	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	1,766,164	1,514,782	141,293	121,182
17	うち、標準的方式適用分	899,319	890,462	71,945	71,237
18	うち、内部モデル方式適用分	866,845	624,320	69,347	49,945
19	オペレーショナル・リスク	955,149	969,051	76,411	77,524
20	うち、基礎的手法適用分	955,149	969,051	76,411	77,524
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	177,480	189,313	14,198	15,145
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	-	-	-	-
24	フロア調整	-	-	-	-
25	合計	5,572,157	5,089,921	445,772	407,193

【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	-	992,746	43	992,703
2	有価証券(うち負債性のもの)	-	594,127	-	594,127
3	その他オン・バランスシートの資産(うち負債性のもの)	41	4,470,337	1,880	4,468,499
4	オン・バランスシートの資産の合計(1+2+3)	41	6,057,211	1,923	6,055,330
オフ・バランスシートの資産					
5	支払承諾等	-	14,050	-	14,050
6	コミットメント等	-	19,004	-	19,004
7	オフ・バランスシートの資産の合計(5+6)	-	33,055	-	33,055
合計					
8	合計(4+7)	41	6,090,266	1,923	6,088,385

(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:2019年3月末 当中間期末:2019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	624	
2	貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の当中間 期中の要因別の変動額	デフォルトした額	-
3		非デフォルト状態へ復帰した額	546
4		償却された額	-
5		その他の変動額	▲ 36
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)	41	

(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	869,389	123,313	123,313	-
2	有価証券(負債性のもの)	594,127	-	-	-
3	その他オン・バランスシートの資産(負債性のもの)	4,468,495	4	4	-
4	合計(1+2+3)	5,932,011	123,317	123,317	-
5	うちデフォルトしたもの	41	-	-	-

【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	4,841,081	-	4,841,081	-	-	-
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	95,637	-	95,637	-	17	0.02%
4	国際決済銀行等向け	-	-	-	-	-	-
5	我が国の地方公共団体向け	0	-	0	-	-	-
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	2,305	-	2,305	-	529	22.94%
7	国際開発銀行向け	125	-	125	-	-	-
8	地方公共団体金融機構向け	1,352	-	1,352	-	263	19.45%
9	我が国の政府関係機関向け	258,315	-	258,315	-	28,601	11.07%
10	地方三公社向け	1	-	1	-	0	20.00%
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	578,892	19,004	578,892	3,801	123,881	21.26%
12	法人等向け	354,215	14,054	230,897	14,041	240,054	98.01%
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	12,846	2,425	12,846	2,425	15,272	100.00%
16	三月以上延滞等 (抵当権付住宅ローンを除く。)	42	-	42	-	63	150.00%
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。)	275,324	-	275,324	-	275,324	100.00%
22	合計	6,420,134	35,483	6,296,817	20,267	684,005	10.83%

【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	信用リスク・エクスポージャーの額 (CCF・信用リスク削減手法適用後)					
		リスク・ウェイト	0%	10%	20%	35%	50%
1	現金	-	-	-	-	-	-
2	日本国政府及び日本銀行向け	4,841,081	-	-	-	-	-
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	95,578	-	41	-	19	-
4	国際決済銀行等向け	-	-	-	-	-	-
5	我が国の地方公共団体向け	0	-	-	-	-	-
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	-	2,220	-	-	-
7	国際開発銀行向け	125	-	-	-	-	-
8	地方公共団体金融機構向け	-	74	1,278	-	-	-
9	我が国の政府関係機関向け	-	230,616	27,699	-	-	-
10	地方三公社向け	-	-	1	-	-	-
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	-	-	564,245	-	14,833	-
12	法人等向け	-	-	1,485	-	7,393	-
13	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-	-	-	-
14	抵当権付住宅ローン	-	-	-	-	-	-
15	不動産取得等事業向け	-	-	-	-	-	-
16	三月以上延滞等 (抵当権付住宅ローンを除く。)	-	-	-	-	-	-
17	抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞	-	-	-	-	-	-
18	取立未済手形	-	-	-	-	-	-
19	信用保証協会等による保証付	-	-	-	-	-	-
20	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	-	-	-	-	-	-
21	出資等(重要な出資を除く。)	-	-	-	-	-	-
22	合計	4,936,784	230,690	596,968	-	22,244	-

	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)				合計
		100%	150%	250%	1250%	
資産クラス						
1 現金		-	-	-	-	-
2 日本国政府及び日本銀行向け		-	-	-	-	4,841,081
3 外国の中央政府及び中央銀行向け		-	-	-	-	95,637
4 国際決済銀行等向け		-	-	-	-	-
5 我が国の地方公共団体向け		-	-	-	-	0
6 外国の中央政府等以外の公共部門向け	85	-	-	-	-	2,305
7 国際開発銀行向け		-	-	-	-	125
8 地方公共団体金融機構向け		-	-	-	-	1,352
9 我が国の政府関係機関向け		-	-	-	-	258,315
10 地方三公社向け		-	-	-	-	1
11 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	3,616	-	-	-	-	582,693
12 法人等向け	236,060	-	-	-	-	244,938
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	15,272	-	-	-	-	15,272
16 三月以上延滞等 (抵当権付住宅ローンを除く。)		-	42	-	-	42
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。)	275,324	-	-	-	-	275,325
22 合計		530,357	42	-	-	6,317,086

【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	154,545	227,525		1.4	534,899	326,211
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					525,684	310,170
5	エクスポージャー変動推計モデル					-	-
6	合計						636,381

【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	477,187	329,919
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	477,187	329,919

【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	1,216	-	-
2	外国の中央政府及び中央銀行向け	22,942	-	1,192
3	国際決済銀行等向け	65	-	-
4	我が国の地方公共団体向け	69	-	-
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	-	46,152
6	国際開発銀行向け	6,040	-	-
7	地方公共団体金融機構向け	-	-	3,848
8	我が国の政府関係機関向け	-	9,901	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	-	-	415,150
11	法人等向け	-	-	6,395
12	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-
13	上記以外	-	-	-
14	合計	30,333	9,901	473,191

(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	112	-	-
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	65	-	-
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	340	-	84
11	法人等向け	12,288	-	534,265
12	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-
13	上記以外	-	-	-
14	合計	12,807	-	534,349

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	-	-	1,216
2	外国の中央政府及び中央銀行向け	-	-	24,247
3	国際決済銀行等向け	-	-	65
4	我が国の地方公共団体向け	-	-	69
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	-	46,217
6	国際開発銀行向け	-	-	6,040
7	地方公共団体金融機構向け	-	-	3,848
8	我が国の政府関係機関向け	-	-	10,354
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	-	-	415,574
11	法人等向け	-	-	552,949
12	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-
13	上記以外	-	-	-
14	合計	-	-	1,060,583

【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)	15,326	172,792	95,916	223,780	3,239,848	2,254,795
2	現金(その他通貨)	66,729	20,016	2,471	17,845	4,971,669	4,033,115
3	国内ソブリン債	223	22,926	-	8,576	1,280,346	1,854,366
4	その他ソブリン債	367	-	-	-	3,327,165	3,610,951
5	政府関係機関債	1,567	-	-	-	906,491	1,475,090
6	社債	39,962	-	-	-	48,854	127,502
7	株式	9,431	763	48,327	50	623,977	292,038
8	その他担保	3,744	-	-	-	23,498	52,134
9	合計	137,354	216,498	146,714	250,251	14,421,851	13,699,995

(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	691,242	904,942
2	インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ	345,788	349,767
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	208,759	-
6	想定元本合計	1,245,790	1,254,709
	公正価値		
7	プラスの公正価値(資産)	1,985	17,196
8	マイナスの公正価値(負債)	▲ 18,373	▲ 6,154

【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)		16,191
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。)	231,808	4,636
3	(i) 派生商品取引(上場以外)	109,510	2,190
4	(ii) 派生商品取引(上場)	11,874	237
5	(iii) レポ形式の取引	110,422	2,208
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	135,668	
8	分別管理されていない当初証拠金	18,896	426
9	事前拠出された清算基金	48,550	11,128
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)	145,417	-	145,417
2	担保付住宅ローン	88,157	-	88,157
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	57,260	-	57,260
5	再証券化	-	-	-
6	ホールセール(合計)	471,827	-	471,827
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	183	-	183
10	その他のホールセール	471,644	-	471,644
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)	1,649	-	1,649
2	担保付住宅ローン	1,649	-	1,649
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)	46	-	46
2	担保付住宅ローン	46	-	46
3	クレジットカード債権	-	-	-
4	その他リテールに係るエクスポージャー	-	-	-
5	再証券化	-	-	-
6	ホールセール(合計)	-	2,893	2,893
7	事業法人向けローン	-	2,893	2,893
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			ホール セール
			裏付けとなる リテール			
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	602,745	602,745	602,745	130,917	471,827
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	14,500	14,500	14,500	14,500	-
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	617,245	617,245	617,245	145,417	471,827
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	127,643	127,643	127,643	33,286	94,356
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	10,211	10,211	10,211	2,662	7,548
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				
		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	657,245
2	株式リスク(一般市場リスク及び個別リスク)の額	142,917
3	外国為替リスクの額	80,656
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	18,500
9	合計	899,319

【MR2】内部モデル方式を適用して算出されたリスク・アセットの額の変動要因

(単位 百万円)

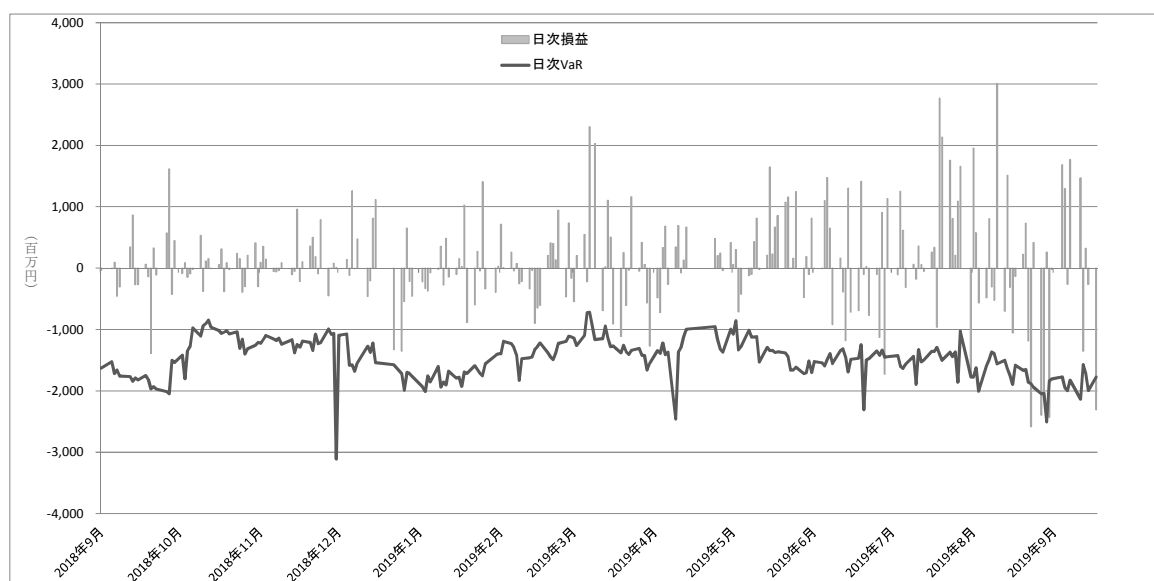
	前四半期末:2019年6月末 当四半期末:2019年9月末	バリュエーション・ アット・リスク	ストレス・ バリュエーション・ アット・リスク	追加的 リスク	包括的 リスク	その他	合計
1a	前四半期末におけるリスク・アセット	168,261	456,058	-	-		624,320
1b	前四半期末における連結自己資本規制上のリスク・アセット額への調整	3.38	3.33	-	-		3.34
1c	前四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	49,651	136,844	-	-		186,496
2	当四半期の 要因別の 変動額	リスク量の変動	5,584	38,002	-	-	43,587
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	55,236	174,847	-	-	
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	3.59	3.82	-	-		3.76
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	198,308	668,536	-	-		866,845

【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	9,110
2	平均値	4,703
3	最小値	1,932
4	期末	4,418
	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	19,606
6	平均値	12,503
7	最小値	4,638
8	期末	13,987
	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	
		2019年9月末	2018年9月末
1	上方パラレルシフト	6,034	4,555
2	下方パラレルシフト	25,744	27,769
3	スティープ化	1,178	2,037
4	フラット化	402	587
5	短期金利上昇	2,674	1,755
6	短期金利低下	19,330	15,753
7	最大値	25,744	27,769
		2019年9月末	2018年9月末
8	Tier1 資本の額	1,061,011	1,105,298

(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	2.50%	13,188		
スウェーデン	2.00%	831		
英国	1.00%	42,382		
フランス	0.25%	823		
小計		57,225		
合計		2,217,793	0.03%	665

(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	2019年9月末	2018年9月末
オン・バランス資産の額 (1)				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	13,415,147	11,558,980
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	22,809,247	20,963,519
1b	2	連結レバレッジ比率の範囲に含まれない子法人等の資産の額(△)	-	-
1c	7	連結レバレッジ比率の範囲に含まれる子会社の資産の額(連結貸借対照表における総資産の額に含まれる額を除く。)	-	-
1d	3	連結貸借対照表における総資産の額から控除される調整項目以外の資産の額(△)	9,394,100	9,404,539
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(△)	158,271	149,142
3		オン・バランス資産の額 (イ)	13,256,876	11,409,838
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	496,185	-
		デリバティブ取引等に関する再構築コストの額	-	421,102
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	403,272	-
		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	-	1,331,249
		デリバティブ取引等に関連して現金で差入れた証拠金の対価の額	-	309,389
6		連結貸借対照表から控除されているデリバティブ取引等に関連して差入れた担保の対価の額	-	-
		連結貸借対照表から控除されているデリバティブ取引等に関連して現金で差入れた変動証拠金の対価の額	-	-
7		デリバティブ取引等に関連して現金で差入れた変動証拠金の対価の額のうち控除する額(△)	190,393	92,504
8		清算会員である最終指定親会社等が補償を義務付けられていない顧客とのトレード・エクスポージャーの額(△)		
9		クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額	1,254,709	1,261,095
10		クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額から控除した額(△)	974,889	996,293
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	988,884	2,234,038
レボ取引等に関する額 (3)				
12		レボ取引等に関する資産の額	6,278,838	7,635,941
13		レボ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	1,403,844	1,617,685
14		レボ取引等に関するカウンターパーティ・リスクのエクスポージャーの額	194,797	183,463
15		代理取引のエクスポージャーの額		
16	5	レボ取引等に関する額 (ハ)	5,069,791	6,201,719
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	152,665	124,169
18		オフ・バランス取引に係るエクスポージャーの額への変換調整の額(△)	50,812	52,804
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	101,853	71,365
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	1,061,011	1,105,298
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	19,417,404	19,916,960
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	5.46%	5.54%

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	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	普通株式
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)	
	連結自己資本規制比率	1,191,615 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外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2006年7月発行新株予約権	2007年7月発行新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	145 百万円	198 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	有	有
13	その日付	2026年6月30日	2027年6月30日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (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	剰余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2008年7月発行新株予約権	2009年7月発行新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	183 百万円	252 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	有	有
13	その日付	2028年6月30日	2029年6月30日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (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	剰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、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2010年7月発行新株予約権	第7回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	301 百万円	209 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2010年7月1日	2010年9月1日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2030年6月30日	2020年6月25日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (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	剰余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2011年7月発行新株予約権	第8回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	366 百万円	211 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2011年7月1日	2011年9月5日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2031年6月30日	2021年6月24日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (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	剰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、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2013年2月発行新株予約権	第9回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	415 百万円	962 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2013年2月12日	2013年2月12日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2032年6月30日	2022年6月26日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (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	剰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、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2014年2月発行新株予約権	第10回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	355 百万円	1,082 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2014年2月10日	2014年2月10日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2033年6月30日	2023年6月25日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (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	剰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、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2015年2月発行新株予約権	第11回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	375 百万円	951 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2015年2月9日	2015年2月9日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2034年6月30日	2024年6月25日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (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	剰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、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2016年2月発行新株予約権	第12回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	376 百万円	414 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	有	有
13	その日付	2035年6月30日	2025年6月24日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (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	剰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、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2017年2月発行新株予約権	第13回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	404 百万円	536 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	有	有
13	その日付	2036年6月30日	2026年6月27日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (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	剰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、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2018年2月発行新株予約権	第14回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	435 百万円	341 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	有	有
13	その日付	2037年6月30日	2027年6月27日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (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	剰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、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	第15回新株予約権	第16回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	184 百万円	15 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	有	有
13	その日付	2028年6月26日	2029年7月30日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (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	剰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

<お問い合わせ先>

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