

# News Release

2020年11月12日

各位

会社名 極東証券株式会社  
 代表者名 代表取締役社長 菊池 一広  
 コード番号 8706 (東証第1部)  
 本店所在地 東京都中央区日本橋茅場町1-4-7  
 問合せ先 取締役専務執行役員企画管理本部長  
 茅沼 俊三 (TEL 03-3666-5130)

## 自己資本規制比率の訂正に関するお知らせ

過去に開示いたしました自己資本規制比率の算出方法に誤りがありましたので、下記のとおり訂正いたします。

### 記

#### 1. 訂正対象となる開示資料

項番	開示資料	対象期間
(1)	有価証券報告書	2016年3月期、2017年3月期、2018年3月期、2019年3月期、2020年3月期
(2)	四半期報告書	2018年3月期(第2、第3四半期)、2019年3月期(第2、第3四半期) 2020年3月期(各四半期)、2021年3月期第1四半期
(3)	決算短信	2016年3月期(第3四半期、本決算)、2017年3月期(各四半期、本決算) 2018年3月期(各四半期、本決算)、2019年3月期(第2四半期、本決算) 2020年3月期(各四半期、本決算)、2021年3月期第1四半期

#### 2. 訂正理由

自己資本規制比率の算出において、市場リスク相当額のリスクの認識に誤りがありました。そのため、過去に遡って市場リスク相当額を確認したところ、上記対象期間における市場リスク相当額に誤りがあることから、当該リスク相当額及び自己資本規制比率を訂正するものであります。

なお、訂正対象となる開示資料にある決算短信のうち、四半期決算短信の訂正については、本開示をもって代えさせていただきます。

3. 訂正箇所 (訂正箇所には下線を付しております。なお、訂正対象となる開示資料について、上記対象期間のうち自己資本規制比率等が変更となる該当期のみを記載しております。)

#### (1) 2016(平成28)年3月期第3四半期

(単位:百万円)

		訂正前	訂正後	差異
基本的項目	(A)	39,799	39,799	—
補完的項目	その他有価証券評価差額金(評価益)等	530	530	—
	金融商品取引責任準備金	27	27	—
	貸倒引当金	5	5	—
	計	(B) 563	563	—
控除資産	(C)	14,145	14,145	—
固定化されていない自己資本	(A) + (B) - (C) (D)	26,217	26,217	—
リスク相当額	市場リスク相当額	<u>4,162</u>	<u>4,164</u>	2
	取引先リスク相当額	398	398	—
	基礎的リスク相当額	1,365	1,365	—
	計	(E) <u>5,927</u>	<u>5,929</u>	2
自己資本規制比率	(D) / (E) × 100 (%)	<u>442.3%</u>	<u>442.1%</u>	△0.2 pt

## (2)2016(平成28)年3月期

(単位:百万円)

		訂正前	訂正後	差異
基本的項目	(A)	39,522	39,522	—
補完的項目	その他有価証券評価差額金(評価益)等	262	262	—
	金融商品取引責任準備金	27	27	—
	貸倒引当金	3	3	—
	計	293	293	—
控除資産	(C)	13,609	13,609	—
固定化されていない自己資本	(A) + (B) - (C)	26,206	26,206	—
リスク相当額	市場リスク相当額	3,905	3,904	△0
	取引先リスク相当額	336	336	—
	基礎的リスク相当額	1,297	1,297	—
	計	5,538	5,537	△0
自己資本規制比率	(D) / (E) × 100 (%)	473.2%	473.2%	0.0 pt

## (3)2017(平成29)年3月期第2四半期

(単位:百万円)

		訂正前	訂正後	差異
基本的項目	(A)	40,366	40,366	—
補完的項目	その他有価証券評価差額金(評価益)等	298	298	—
	金融商品取引責任準備金	25	25	—
	貸倒引当金	2	2	—
	計	326	326	—
控除資産	(C)	6,154	6,154	—
固定化されていない自己資本	(A) + (B) - (C)	34,538	34,538	—
リスク相当額	市場リスク相当額	3,821	3,821	0
	取引先リスク相当額	222	222	—
	基礎的リスク相当額	1,258	1,258	—
	計	5,302	5,302	0
自己資本規制比率	(D) / (E) × 100 (%)	651.4%	651.3%	△0.1 pt

## (4)2017(平成29)年3月期第3四半期

(単位:百万円)

		訂正前	訂正後	差異
基本的項目	(A)	41,094	41,094	—
補完的項目	その他有価証券評価差額金(評価益)等	477	477	—
	金融商品取引責任準備金	25	25	—
	貸倒引当金	2	2	—
	計	505	505	—
控除資産	(C)	5,903	5,903	—
固定化されていない自己資本	(A) + (B) - (C)	35,697	35,697	—
リスク相当額	市場リスク相当額	4,152	4,150	△1
	取引先リスク相当額	266	266	—
	基礎的リスク相当額	1,288	1,288	—
	計	5,707	5,705	△1
自己資本規制比率	(D) / (E) × 100 (%)	625.4%	625.6%	0.2 pt

## (5)2017(平成29)年3月期

(単位:百万円)

		訂正前	訂正後	差異
基本的項目	(A)	40,515	40,515	—
補完的項目	その他有価証券評価差額金(評価益)等	416	416	—
	金融商品取引責任準備金	25	25	—
	貸倒引当金	2	2	—
	計 (B)	444	444	—
控除資産	(C)	5,856	5,856	—
固定化されていない自己資本 (A) + (B) - (C)	(D)	35,103	35,103	—
リスク相当額	市場リスク相当額	4,225	4,224	△1
	取引先リスク相当額	246	246	—
	基礎的リスク相当額	1,311	1,311	—
	計 (E)	5,784	5,783	△1
自己資本規制比率 (D) / (E) × 100 (%)		606.8%	606.9%	0.1 pt

## (6)2018(平成30)年3月期第2四半期

(単位:百万円)

		訂正前	訂正後	差異
基本的項目	(A)	40,154	40,154	—
補完的項目	その他有価証券評価差額金(評価益)等	416	416	—
	金融商品取引責任準備金	20	20	—
	貸倒引当金	2	2	—
	計 (B)	440	440	—
控除資産	(C)	5,882	5,882	—
固定化されていない自己資本 (A) + (B) - (C)	(D)	34,712	34,712	—
リスク相当額	市場リスク相当額	4,153	4,154	0
	取引先リスク相当額	374	374	—
	基礎的リスク相当額	1,237	1,237	—
	計 (E)	5,765	5,766	0
自己資本規制比率 (D) / (E) × 100 (%)		602.0%	602.0%	△0.0 pt

## (7)2019年3月期

(単位:百万円)

		訂正前	訂正後	差異
基本的項目	(A)	41,211	41,211	—
補完的項目	その他有価証券評価差額金(評価益)等	357	357	—
	金融商品取引責任準備金	19	19	—
	貸倒引当金	1	1	—
	計 (B)	378	378	—
控除資産	(C)	5,010	5,010	—
固定化されていない自己資本 (A) + (B) - (C)	(D)	36,579	36,579	—
リスク相当額	市場リスク相当額	4,547	4,552	5
	取引先リスク相当額	213	213	—
	基礎的リスク相当額	1,295	1,295	—
	計 (E)	6,057	6,062	5
自己資本規制比率 (D) / (E) × 100 (%)		603.8%	603.3%	△0.5 pt

## (8)2020年3月期第1四半期

(単位:百万円)

		訂正前	訂正後	差異
基本的項目	(A)	41,617	41,617	—
補完的項目	その他有価証券評価差額金(評価益)等	—	—	—
	金融商品取引責任準備金	19	19	—
	貸倒引当金	1	1	—
	計 (B)	21	21	—
控除資産	(C)	5,087	5,087	—
固定化されていない自己資本	(A) + (B) - (C) (D)	36,551	36,551	—
リスク相当額	市場リスク相当額	4,364	4,378	14
	取引先リスク相当額	233	233	—
	基礎的リスク相当額	1,230	1,230	—
	計 (E)	5,828	5,842	14
自己資本規制比率	(D) / (E) × 100 (%)	627.1%	625.5%	△1.6 pt

## (9)2020年3月期第2四半期

(単位:百万円)

		訂正前	訂正後	差異
基本的項目	(A)	40,886	40,886	—
補完的項目	その他有価証券評価差額金(評価益)等	66	66	—
	金融商品取引責任準備金	19	19	—
	貸倒引当金	1	1	—
	計 (B)	86	86	—
控除資産	(C)	5,416	5,416	—
固定化されていない自己資本	(A) + (B) - (C) (D)	35,557	35,557	—
リスク相当額	市場リスク相当額	4,647	4,655	8
	取引先リスク相当額	201	201	—
	基礎的リスク相当額	1,254	1,254	—
	計 (E)	6,103	6,111	8
自己資本規制比率	(D) / (E) × 100 (%)	582.5%	581.8%	△0.7 pt

## (10)2020年3月期第3四半期

(単位:百万円)

		訂正前	訂正後	差異
基本的項目	(A)	41,508	41,508	—
補完的項目	その他有価証券評価差額金(評価益)等	249	249	—
	金融商品取引責任準備金	19	19	—
	貸倒引当金	1	1	—
	計 (B)	270	270	—
控除資産	(C)	5,710	5,710	—
固定化されていない自己資本	(A) + (B) - (C) (D)	36,069	36,069	—
リスク相当額	市場リスク相当額	4,100	4,101	1
	取引先リスク相当額	232	232	—
	基礎的リスク相当額	1,243	1,243	—
	計 (E)	5,576	5,577	1
自己資本規制比率	(D) / (E) × 100 (%)	646.7%	646.6%	△0.1 pt

## (11)2020年3月期

(単位:百万円)

		訂正前	訂正後	差異
基本的項目	(A)	38,653	38,653	—
補完的項目	その他有価証券評価差額金(評価益)等	—	—	—
	金融商品取引責任準備金	19	19	—
	貸倒引当金	1	1	—
	計 (B)	20	20	—
控除資産	(C)	7,453	7,453	—
固定化されていない自己資本 (A) + (B) - (C)	(D)	31,221	31,221	—
リスク相当額	市場リスク相当額	<u>3,392</u>	<u>3,396</u>	3
	取引先リスク相当額	192	192	—
	基礎的リスク相当額	1,202	1,202	—
	計 (E)	<u>4,787</u>	<u>4,791</u>	3
自己資本規制比率 (D) / (E) × 100 (%)		<u>652.1%</u>	<u>651.6%</u>	△0.5 pt

## (12)2021年3月期第1四半期

(単位:百万円)

		訂正前	訂正後	差異
基本的項目	(A)	39,665	39,665	—
補完的項目	その他有価証券評価差額金(評価益)等	—	—	—
	金融商品取引責任準備金	13	13	—
	貸倒引当金	1	1	—
	計 (B)	15	15	—
控除資産	(C)	8,375	8,375	—
固定化されていない自己資本 (A) + (B) - (C)	(D)	31,305	31,305	—
リスク相当額	市場リスク相当額	<u>3,255</u>	<u>3,274</u>	19
	取引先リスク相当額	255	255	—
	基礎的リスク相当額	1,231	1,231	—
	計 (E)	<u>4,741</u>	<u>4,761</u>	19
自己資本規制比率 (D) / (E) × 100 (%)		<u>660.1%</u>	<u>657.4%</u>	△2.7 pt

以上