

2021年4月28日

各位

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

連結自己資本規制比率及び連結レバレッジ比率に関するお知らせ

－ 経営の健全性の状況 (2020年12月末) －

金融商品取引法第57条の17の規定に基づく大和証券グループ本社の経営の健全性の状況
(2020年12月末) について下記のとおりお知らせいたします。

記

目次

■	主要な指標.....	3
■	自己資本の構成に関する開示事項.....	4
■	定性的な開示事項.....	7
1.	連結貸借対照表の科目と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係.....	7
■	自己資本調達手段に関する契約内容の概要.....	9
■	定量的な開示事項.....	23
1.	その他定量的な開示事項.....	23
■	連結レバレッジ比率に関する開示事項.....	25
1.	連結レバレッジ比率の構成に関する開示.....	25
2.	前四半期の連結レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた原因.....	26

■ 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		2020年 12月末	2020年 9月末	2020年 6月末	2020年 3月末	2019年 12月末
資本						
1	普通株式等Tier1 資本の額	1,079,983	1,034,222	1,043,809	1,035,250	1,088,942
2	Tier1資本の額	1,214,038	1,162,574	1,179,907	1,171,864	1,088,942
3	総自己資本の額	1,214,038	1,162,574	1,179,907	1,171,864	1,088,942
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	5,160,906	5,174,911	5,406,413	5,536,310	5,593,840
自己資本比率						
5	連結普通株式等 Tier1比率	20.92%	19.98%	19.30%	18.69%	19.46%
6	連結Tier1比率	23.52%	22.46%	21.82%	21.16%	19.46%
7	連結総自己資本 比率	23.52%	22.46%	21.82%	21.16%	19.46%
資本バッファー						
8	資本保全バッ ファー比率	2.50%	2.50%	2.50%	2.50%	2.50%
9	カウンター・シクリカ ル・バッファー比率	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.03%
10	G-SIB/D-SIBバッ ファー比率	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%
11	最低連結資本バッ ファー比率	3.00%	3.00%	3.00%	3.00%	3.03%
12	連結資本バッ ファー比率	15.52%	14.46%	13.82%	13.16%	11.46%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポー ジャーの額	18,282,142	18,436,197	18,136,475	20,200,161	21,601,323
14	連結レバレッジ比率	6.64%	6.30%	6.50%	5.80%	5.04%

■ 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	1,232,520	
1a	うち、資本金及び資本剰余金の額	478,097	(i), (j)
2	うち、利益剰余金の額	862,499	(k)
1c	うち、自己株式の額 (Δ)	108,076	(l), (m)
26	うち、社外流出予定額(Δ)	-	
	うち、上記以外に該当するものの額	-	
1b	普通株式に係る新株予約権の額	9,126	(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	18,928	(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)	1,260,575	
	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	166,397	
8	うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	45,128	(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	121,269	(f)
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	192	(d), (h)
11	繰延ヘッジ損益の額	▲ 776	(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	359	
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	53	(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	14,364	(a), (b), (c), (g)
19+20+21	特定項目に係る十パーセント基準超過額	-	
19	うち、その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に該当するものに関連するものの額	-	
20	うち、無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に関連するものの額	-	
21	うち、繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に関連するものの額	-	
22	特定項目に係る十五パーセント基準超過額	-	
23	うち、その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に該当するものに関連するものの額	-	
24	うち、無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に関連するものの額	-	
25	うち、繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に関連するものの額	-	
27	その他Tier1資本不足額	-	
28	普通株式等Tier1資本に係る調整項目の額 (ロ)	180,591	
	普通株式等Tier1資本		
29	普通株式等Tier1資本の額 ((イ) - (ロ)) (ハ)	1,079,983	

(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	148,000	
		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	7,241	(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)	155,241		
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	5,462	(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	15,723		
43	その他Tier1資本に係る調整項目の額 (ホ)	21,186		
その他Tier1資本				
44	その他Tier1資本の額 ((二) - (ホ)) (ヘ)	134,055		
Tier1資本				
45	Tier1資本の額 ((ハ) + (ヘ)) (ト)	1,214,038		
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	1,703	(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)	1,703		

(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	17,427	(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)	17,427	
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)	1,214,038	
リスク・アセット (5)			
60	リスク・アセットの額の合計額 (ヲ)	5,160,906	
連結自己資本規制比率			
61	連結普通株式等Tier1比率 ((ハ) / (ヲ))	20.92%	
62	連結Tier1比率 ((ト) / (ヲ))	23.52%	
63	連結総自己資本規制比率 ((ル) / (ヲ))	23.52%	
64	最低連結資本バッファ比率	3.00%	
65	うち、資本保全バッファ比率	2.50%	
66	うち、カウンター・シクリカル・バッファ比率	0.00%	
67	うち、G-SIB/D-SIB バッファ比率	0.50%	
68	連結資本バッファ比率	15.52%	
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	109,434	(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	68,354	(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	8,699	(d), (h)
Tier2資本に係る基礎項目の額に算入される引当金に関する事項 (7)			
76	一般貸倒引当金の額	-	
77	一般貸倒引当金に係るTier2資本算入上限額	-	
78	内部格付手法採用最終指定親会社において、適格引当金の合計額から事業法人等向けエクスポージャー及びリテール向けエクスポージャーの期待損失額の合計額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-	
79	適格引当金に係るTier2資本算入上限額	-	
資本調達手段に係る経過措置に関する事項 (8)			
82	適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額	-	
83	適格旧Tier1資本調達手段の額から適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-	
84	適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額	-	
85	適格旧Tier2資本調達手段の額から適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-	

■ 定性的な開示事項

1. 連結貸借対照表の科目と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係

【CC2】 連結貸借対照表の科目と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係

(単位 百万円)

項目	公表 連結貸借対照表	規制上の連結範囲に基づく 連結貸借対照表	別紙様式第一号 (CC1)の参照項目
資産の部			
流動資産			
現金・預金	4,594,032	4,599,063	
預託金	484,949	484,949	
受取手形及び売掛金	18,692	18,692	
有価証券 (a)	977,510	977,510	8, 18, 39, 54, 72, 73
トレーディング商品 (b)	8,641,265	8,641,265	16, 18, 39, 54, 72, 73
約定見返勘定	-	-	
営業投資有価証券 (c)	234,761	234,761	18, 39, 54, 72, 73
投資損失引当金	▲ 594	▲ 594	
営業貸付金	1,989,732	1,989,732	
仕掛品	982	982	
信用取引資産	131,157	131,157	
有価証券担保貸付金	7,574,807	7,574,807	
立替金	18,678	18,678	
短期貸付金	1,637	1,637	
未収収益	33,413	33,471	
繰延税金資産 (d)	-	-	10, 75
その他の流動資産	564,268	567,097	
貸倒引当金	▲ 426	▲ 426	
流動資産計	25,264,869	25,272,788	
固定資産			
有形固定資産	316,354	321,589	
無形固定資産	119,558	119,610	
のれん (e)	12,574	12,574	8
のれん以外 (f)	106,984	107,036	9
投資その他の資産	534,190	532,160	
投資有価証券 (g)	487,923	485,521	8, 18, 39, 54, 72, 73
繰延税金資産 (h)	8,886	8,891	10, 75
上記以外	37,381	37,747	
固定資産計	970,104	973,361	
繰延資産計	-	-	
資産の部合計	26,234,974	26,246,150	

(単位 百万円)

項目	公表 連結貸借対照表	規制上の連結範囲に基づく 連結貸借対照表	別紙様式第一号 (CC1)の参照項目
負債の部			
流動負債			
支払手形及び買掛金	5,188	5,188	
トレーディング商品	4,292,463	4,292,463	
約定見返勘定	1,177,349	1,177,349	
信用取引負債	70,660	70,660	
有価証券担保借入金	9,438,657	9,438,657	
銀行業における預金	4,250,517	4,250,517	
預り金	511,775	519,095	
受入保証金	409,526	409,526	
短期借入金	1,395,654	1,395,654	
コマーシャルペーパー	268,000	268,000	
1年内償還予定の社債	205,798	205,798	
未払法人税等	3,399	3,470	
繰延税金負債	-	-	
賞与引当金	21,354	21,354	
その他の流動負債	102,264	102,579	
固定負債			
社債	1,453,179	1,453,179	
長期借入金	1,241,455	1,241,896	
繰延税金負債	6,491	6,491	
退職給付に係る負債	44,726	44,726	
訴訟損失引当金	1,659	1,659	
負ののれん	-	-	
その他の固定負債	30,788	31,371	
特別法上の準備金	3,919	3,919	
負債の部合計	24,934,828	24,943,560	
純資産の部			
株主資本			
資本金 (i)	247,397	247,397	1a
資本剰余金 (j)	230,699	230,699	1a
利益剰余金 (k)	861,220	862,498	2
自己株式 (l)	▲ 108,081	▲ 108,081	1c
自己株式申込証拠金 (m)	4	4	1c
株主資本合計	1,231,241	1,232,519	
その他の包括利益累計額			
その他有価証券評価差額金	36,048	36,048	
繰延ヘッジ損益 (n)	▲ 8,168	▲ 8,168	11
為替換算調整勘定	▲ 8,992	▲ 8,953	
その他の包括利益累計額 (o)	18,888	18,927	3
新株予約権 (p)	9,126	9,126	1b
非支配株主持分 (q)	40,888	42,013	34-35, 48-49
純資産の部合計	1,300,145	1,302,589	

■ 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	1,232,520 百万円
9	額面総額 (5)	—
10	表示される科目の区分 (6)	
	連結貸借対照表	株主資本
11	発行日 (7)	—
12	償還期限の有無	無
13	その日付	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—
	剰余金の配当又は利息の支払	
17	配当率又は利率の種類 (11)	変動
18	配当率又は利率 (12)	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—
25	転換の範囲 (16)	—
26	転換の比率 (17)	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—
34	その概要	—
34a	劣後性の手段(23)	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2006年7月発行新株予約権	2007年7月発行新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	107 百万円	157 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	145 百万円	220 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	264 百万円	353 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	第8回新株予約権	2013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	167 百万円	410 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9月5日	2013年2月12日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段 (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9回新株予約権	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	947 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)	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	第10回新株予約権	2015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	1,058 百万円	372 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	2015年2月9日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段 (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11回新株予約権	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	928 百万円	370 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	489 百万円	398 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	794 百万円	432 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	601 百万円	382 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	132 百万円	50 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	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	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	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
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	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 7,241百万円 Tier2資本に係る基礎項目の額 1,703百万円
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
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	劣後性的手段(23)	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	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	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	123,200 百万円	24,800 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	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 (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	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)	—	—

■ 定量的な開示事項

1. その他定量的な開示事項

【OV1】 リスク・アセットの概要

(単位: 百万円)

国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2020年 12月末	2020年 9月末	2020年 12月末	2020年 9月末
1	信用リスク	1,252,664	1,183,817	100,199	94,705
2	うち、標準的手法適用分	888,237	829,630	71,058	66,370
3	うち、内部格付手法適用分	-	-	-	-
	うち、重要な出資のエクスポージャー	-	-	-	-
	うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー	-	-	-	-
	その他	364,427	354,187	29,140	28,334
4	カウンターパーティ信用リスク	1,087,901	1,007,826	87,032	80,626
5	うち、SA-CCR適用分	452,639	409,182	36,211	32,734
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	384,350	333,877	30,748	26,710
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	20,519	19,211	1,641	1,536
	その他	230,392	245,554	18,431	19,644
7	マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	-	-	-	-
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (ルック・スルー方式)	475,514	468,067	38,041	37,445
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (マンドート方式)	27,256	20,880	2,180	1,670
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式250%)	-	-	-	-
	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%)	543	983	43	78
11	未決済取引	1,096	37	87	3
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー	117,841	115,557	9,427	9,244
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	115,474	113,190	9,237	9,055
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	2,367	2,367	189	189
16	マーケット・リスク	1,097,422	1,257,934	87,793	100,634
17	うち、標準的方式適用分	809,255	816,921	64,740	65,353
18	うち、内部モデル方式適用分	288,167	441,012	23,053	35,281
19	オペレーショナル・リスク	907,891	920,366	72,631	73,629
20	うち、基礎的手法適用分	907,891	920,366	72,631	73,629
21	うち、粗利益配分手法適用分	-	-	-	-
22	うち、先進的計測手法適用分	-	-	-	-
23	特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー	192,773	199,440	15,421	15,955
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	-	-	-	-
24	フロア調整	-	-	-	-
25	合計	5,160,906	5,174,911	412,872	413,992

【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:2020年9月末 当四半期末:2020年12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	139,211	301,801	-	-		441,012	
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	3.69	9.54	-	-		6.36	
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	37,639	31,604	-	-		69,244	
2	当四半期 の 要因別の 変動額	リスク量の変動	13,646	20,457	-	-		34,104
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	51,285	52,062	-	-		103,348	
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	2.06	3.50	-	-		2.78	
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	105,650	182,516	-	-		288,167	

■ 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	2020年12月末	2020年9月末
オン・バランス資産の額 (1)				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	11,329,789	11,866,680
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	22,103,269	21,934,491
1b	2	連結レバレッジ比率の範囲に含まれない子法人等の資産の額(△)	-	-
1c	7	連結レバレッジ比率の範囲に含まれる子会社の資産の額(連結貸借対照表における総資産の額に含まれる額を除く。)	11,176	12,365
1d	3	連結貸借対照表における総資産の額から控除される調整項目以外の資産の額(△)	10,784,656	10,080,176
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(△)	186,470	202,818
3		オン・バランス資産の額 (イ)	11,143,319	11,663,862
デリバティブ取引等に関する額 (2)				
4		デリバティブ取引等に関するRC の額に1.4 を乗じた額	479,943	481,299
5		デリバティブ取引等に関するPFE の額に1.4 を乗じた額	667,252	619,133
6		連結貸借対照表から控除されているデリバティブ取引等に関連して差し入れた担保の対価の額	-	-
7		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた変動証拠金の対価の額のうち控除する額(△)	85,595	89,461
8		清算会員である最終指定親会社等が補償を義務付けられていない顧客とのトレード・エクスポージャーの額(△)		
9		クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額	1,131,357	1,309,134
10		クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額から控除した額(△)	828,344	965,198
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	1,364,613	1,354,907
レポ取引等に関する額 (3)				
12		レポ取引等に関する資産の額	8,139,875	7,541,687
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	2,671,362	2,411,994
14		レポ取引等に関するカウンターパーティ・リスクのエクスポージャーの額	161,029	157,217
15		代理取引のエクスポージャーの額		
16	5	レポ取引等に関する額 (ハ)	5,629,542	5,286,910
オフ・バランス取引に関する額 (4)				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	218,139	209,798
18		オフ・バランス取引に係るエクスポージャーの額への変換調整の額(△)	73,471	79,280
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	144,668	130,518
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	1,214,038	1,162,574
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	18,282,142	18,436,197
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	6.64%	6.30%
日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率 (6)				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	18,282,142	18,436,197
		日本銀行に対する預け金の額	4,131,705	3,649,118
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーの額 (ヘ')	22,413,847	22,085,315
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ'))	5.41%	5.26%

2. 前四半期の連結レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた原因

当四半期と前四半期の連結レバレッジ比率との間に著しい差異はありません。

以 上