

2026 年 7 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 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（2026 年 3 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
（2026 年 3 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. 自己資本の充実度に関する評価方法の概要.....	8
3. 会社グループ全体のリスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要.....	9
4. 信用リスクに関する事項.....	15
5. 信用リスク削減手法に関するリスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要（派生商品取引及びレボ形式の取引等に関連して用いられる信用リスク削減手法を除く）.....	16
6. 派生商品取引及びレボ形式の取引等の相手方に対する信用リスク（カウンターパーティ信用リスク）に関するリスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要（カウンターパーティ信用リスクの削減手法に関するものを含む）.....	16
7. 証券化取引に係るリスクに関する事項.....	17
7の2.CVA リスクに関する事項.....	18
8. マーケット・リスクに関する事項.....	19
9. オペレーショナル・リスクに関する事項.....	20
10. 信用リスク・アセットの額の算出対象となっている株式及び連結自己資本規制比率告示第 43 条第 2 項に規定する株式と同等の性質を有するものに対するエクスポージャー又は株式等エクスポージャーに関するリスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要.....	21
11. 金利リスクに関する事項.....	21
12. 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.....	22
13. 連結自己資本規制比率規制上のエクスポージャーの額と連結貸借対照表計上額との差異及びその要因に関する説明.....	24
■ 定量的な開示事項.....	25
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.....	25
2. 信用リスク（カウンターパーティ信用リスク及び証券化取引に係るリスクを除く）に関する事項.....	25
3. 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.....	27
4. その他定量的な開示事項.....	28
■ 連結レバレッジ比率に関する開示事項.....	57
1. 連結レバレッジ比率の構成に関する開示.....	57
2. 前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.....	59
■ 自己資本調達手段に関する契約内容の概要.....	60

■ 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		2026年 3月末	2025年 12月末	2025年 9月末	2025年 6月末	2025年 3月末
資本						
1	普通株式等Tier1資本の額	1,434,469	1,435,969	1,356,407	1,355,894	1,351,434
2	Tier1資本の額	1,618,172	1,622,704	1,542,917	1,544,076	1,540,625
3	総自己資本の額	1,622,794	1,626,725	1,547,863	1,550,812	1,547,823
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	8,087,806	7,506,249	7,381,082	7,104,033	7,086,475
4a	リスク・アセットの額 (フロア調整前)	8,087,806	7,506,249	7,381,082	7,104,033	7,086,475
	リスク・アセットの額 (フロア調整最終実施ベース)	8,087,806	7,506,249	7,381,082	7,104,033	7,086,475
自己資本比率						
5	連結普通株式等Tier1比率	17.73%	19.13%	18.37%	19.08%	19.07%
5a	連結普通株式等Tier1比率 (フロア調整前)	17.73%	19.13%	18.37%	19.08%	19.07%
	連結普通株式等Tier1比率 (フロア調整最終実施ベース)	17.73%	19.13%	18.37%	19.08%	19.07%
6	連結Tier1比率	20.00%	21.61%	20.90%	21.73%	21.74%
6a	連結Tier1比率 (フロア調整前)	20.00%	21.61%	20.90%	21.73%	21.74%
	連結Tier1比率 (フロア調整最終実施ベース)	20.00%	21.61%	20.90%	21.73%	21.74%
7	連結総自己資本比率	20.06%	21.67%	20.97%	21.83%	21.84%
7a	連結総自己資本比率 (フロア調整前)	20.06%	21.67%	20.97%	21.83%	21.84%
	連結総自己資本比率 (フロア調整最終実施ベース)	20.06%	21.67%	20.97%	21.83%	21.84%
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%	0.10%	0.10%	0.10%
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%	3.10%	3.10%	3.10%
12	連結資本バッファー比率	12.06%	13.67%	12.97%	13.83%	13.84%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	31,705,504	30,752,545	29,273,935	28,286,364	28,859,210
14	連結レバレッジ比率	5.10%	5.27%	5.27%	5.45%	5.33%

■ 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	1,437,120	
1a	うち、資本金及び資本剰余金の額	513,935	(i), (j)
2	うち、利益剰余金の額	1,121,200	(k)
1c	うち、自己株式の額 (△)	149,516	(l), (m)
26	うち、社外流出予定額 (△)	48,497	
	うち、上記以外に該当するものの額	-	
1b	普通株式に係る株式引受権及び新株予約権の合計額	5,821	(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	277,734	(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)	1,720,676	
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	204,699	
8	うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	64,681	(e)
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	140,017	(f)
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	99	(d), (h)
11	繰延ヘッジ損益の額	▲ 2,480	(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	598	
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	140	(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	19,571	(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	63,579	
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	63,579	
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)	286,207	
普通株式等Tier1資本			
29	普通株式等Tier1資本の額 ((イ) - (ロ)) (ハ)	1,434,469	

(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株式引受権及び新株予約権の合計額	-
	32	その他Tier1資本調達手段に係る負債の額	146,200
		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	その他Tier1資本に係る調整後非支配株主持分等の額		42,763 (q)
36	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 (二)		188,963
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		2,786 (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		2,473
42	Tier2資本不足額		-
43	その他Tier1資本に係る調整項目の額 (ホ)		5,260
その他Tier1資本			
44	その他Tier1資本の額 ((二) - (ホ)) (ヘ)		183,703
Tier1資本			
45	Tier1資本の額 ((ハ) + (ヘ)) (ト)		1,618,172
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株式引受権及び新株予約権の合計額		-
	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	Tier2資本に係る調整後非支配株主持分等の額		10,061 (q)
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)		10,061

(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	5,439	(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)	5,439	
Tier2資本			
58	Tier2資本の額 ((チ) - (リ)) (ヌ)	4,621	
総自己資本			
59	総自己資本の額 ((ト) + (ヌ)) (ル)	1,622,794	
リスク・アセット (5)			
60	リスク・アセットの額の合計額 (ヲ)	8,087,806	
連結自己資本規制比率			
61	連結普通株式等Tier1比率 ((ハ) / (ヲ))	17.73%	
62	連結Tier1比率 ((ト) / (ヲ))	20.00%	
63	連結総自己資本規制比率 ((ル) / (ヲ))	20.06%	
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	12.06%	
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	151,761	(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	149,804	(a), (b), (c), (g)
74	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に係る調整項目不算入額	-	
75	繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に係る調整項目不算入額	7,275	(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	-	

■ 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会社グループに属する会社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	138 社
主要な連結子会社の名称	主要な業務の内容
大和証券株式会社	有価証券関連業、投資助言・代理業
大和アセットマネジメント株式会社	投資運用業、投資助言・代理業
株式会社大和総研	情報サービス業
株式会社大和証券ビジネスセンター	事務代行業
大和証券ファシリティーズ株式会社	不動産賃貸業・管理業
株式会社大和ネクスト銀行	銀行業
大和企業投資株式会社	投資業
大和PIパートナーズ株式会社	投資業
大和エナジー・インフラ株式会社	投資業
大和リアル・エステート・アセット・マネジメント株式会社	投資運用業、投資助言・代理業
大和証券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	733	373
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	288	274
Asian Energy Investments Pte., Ltd.	投資運用業、投資助言・代理業	21	19
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	476	428
Daiwa Corporate Investment Asia Ltd.	投資業	289	275
アイ・エル・シー株式会社	投資運用業、投資助言・代理業	362	▲ 1,008
Rimor Fund I GP Limited	投資運用業	146	129
Rimor Fund II GP Limited	投資運用業	50	42

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. 自己資本の充実度に関する評価方法の概要

当社グループでは、自己資本の充実を図るため、「経済資本管理規程」及び「規制資本管理規程」を定め、自己資本の充実度を経済資本、規制資本及びストレス・テストにより評価しております。

<経済資本>

当社グループでは、リスクアペタイト・フレームワークに基づいて自己資本から一定のストレス状況に耐えうる資本バッファ等を考慮の上、主要なグループ会社等に対し経済資本を配賦しております。経済資本配賦の際には、グループ会社等の過去の実績や業務運営方針・予算等を考慮した上で決定しております。グループ会社等が業務運営に伴い保有するリスクを計量化し、当該リスクが配賦した経済資本の範囲内に収まっていることを確認することにより、自己資本の充実度を評価しております。

＜規制資本＞

法令上の最低所要自己資本規制比率を上回る自己資本を確保するだけでなく、グループ内の警戒水準を設定してリスクに見合う十分な自己資本が確保されているかを定期的に評価しております。

＜ストレス・テスト＞

当社グループでは、ストレス・テストの手法を活用して、一定のストレス状況に置かれた場合の当社グループの健全性への影響等を分析し、経済資本・規制資本の観点から計画の妥当性の検証をしております。ストレス・テストにあたっては、専門家・関連部署等による議論を交えながら、内外の環境を分析し、複数のシナリオを策定します。

3. 会社グループ全体のリスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要

当社グループでは、経営レベルでのリスクガバナンスの強化を目的に、リスクアペタイト・フレームワークを活用しております。

また、経営上保有する各種リスクについて、その特性に応じて適切に管理するための基本的事項を定め、財務の健全性及び業務の適切性を確保する体制を構築しております。

＜リスクアペタイト・フレームワーク＞

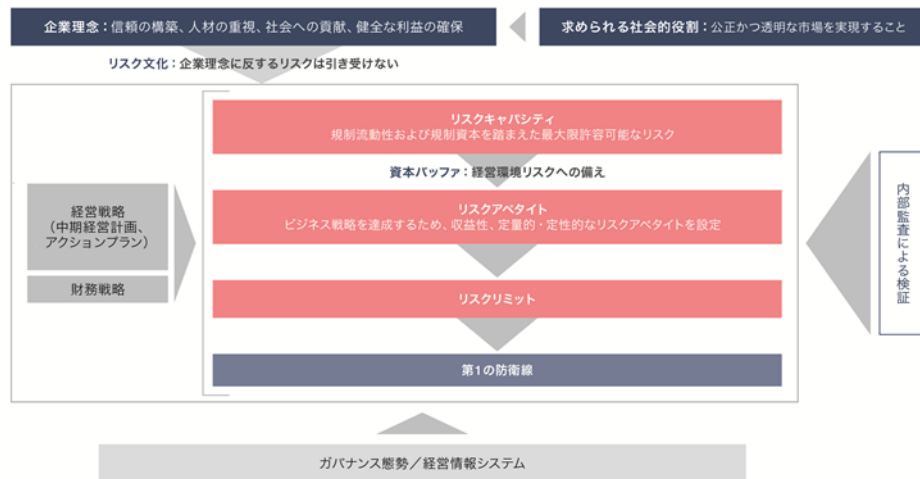
リスクアペタイト・フレームワークとは、ビジネス戦略達成のために進んで受け入れるべきリスクの種類と総量をリスクアペタイトとして定め、当社グループ全体のリスクをコントロールする枠組みです。

当社グループでは以下の通りリスクアペタイト・フレームワークを規定し、適切な運営を行っております。

(リスクアペタイト・フレームワークの概要)

当社グループが展開する事業の想定やリスク特性に鑑みて、流動性、自己資本、集中リスク、オペレーショナル・リスク等の観点からリスクアペタイト指標を選定し、受け入れるリスクの水準や超過時の対応を規定の上、管理・モニタリングしています。

当社グループでは、このような枠組みをリスクアペタイト・ステートメントとして文書化し、グループ内へのリスクアペタイトの浸透と経営管理態勢・リスク管理態勢の水準向上を図り、リスク文化の醸成に努めています。



リスクアペタイト・フレームワークにおける役割・責任は以下の通りです。

取締役会

当社グループのリスクアペタイトの定量指標を含め、リスクアペタイト・ステートメントを審議・決定します。

監査委員会

リスクアペタイト・フレームワークに関する取締役会及び経営の職務執行の監査を行います。

グループリスクマネジメント会議

取締役会により承認されたリスクアペタイトを踏まえ、リスクリミット（各種限度額等）を設定します。また、グループ各社のリスク管理態勢及びリスクリミットの抵触状況を含むリスクの状況を適切に把握すること等を通じて、当社グループのリスクアペタイトの枠組みが実効的に機能しているかどうかを監視します。

CEO

当社グループ全体のビジネス戦略、リスク戦略及びリスクアペタイト・フレームワークの策定、見直しを含めたグループ経営全般を統括します。

COO

CEOを補佐し、リスクアペタイト・フレームワークを踏まえたグループ経営全般を統括します。

CFO

当社グループのリスクアペタイト・フレームワークのうち、財務に係る業務全般を統括します。

CRO

リスクアペタイト・ステートメントを策定し、同ステートメントについて取締役会の承認を得ます。また、同ステートメントを踏まえ、グループ各社のリスク管理態勢を整備させ、各社のリスク管理部署が行うリスク管理全般を監視することを含め、グループのリスク管理に係る業務全般を統括します。

CDO

当社グループのリスクアペタイト・フレームワークのうち、データガバナンス及び経営情報システムの構築・運営に係る業務全般を統括します。

各社のリスクマネジメント部門、コンプライアンス部門等

リスクアペタイトを踏まえ、業務規模や特性に応じたリスクリミットを整備し、第2の防衛線として全社的なリスク管理を行います。

各社のビジネスを遂行する部門等

設定されたリスクリミットを踏まえてビジネスを執行するとともに、超過した際にリスク管理部署に超過解消施策を含めた必要な報告が行われるよう適切な態勢を整備し、第1の防衛線として、自律的リスク管理を行います。

内部監査部門

当社グループのリスクアペタイト・フレームワークが実効的に機能しているかを検証するため、適切な内部監査態勢を整備し、第3の防衛線として、独立した立場でリスク管理の枠組みを検証・評価します。

(リスクアペタイト・フレームワークの運営体制)

当社グループでは、取締役会において年二回リスクアペタイト・ステートメントの見直しを行っています。

ビジネス戦略や資本配賦計画等が見直される場合、又は外部環境の著しい変化やリスクプロファイルが当初想定していた水準を大きく上回る可能性が生じた場合には、必要に応じて見直しを行っております。

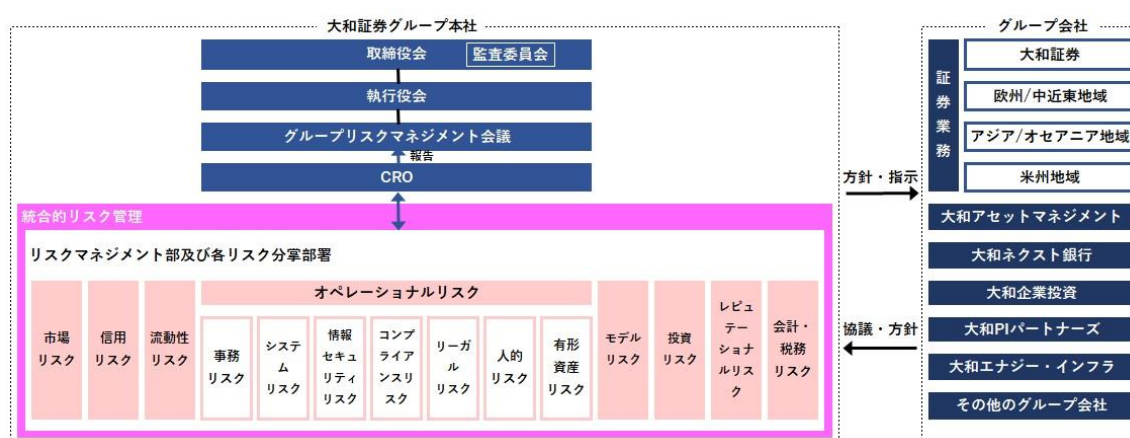
<リスクの特性及び管理方針、リスク管理態勢>

当社グループは、経営上、さまざまなリスクに晒されております。当社グループにとって特に重要なリスクは、中核である証券業務に伴うリスクです。当社グループは、自己勘定を活用して一時的に販売目的の商品ポジションを保有し、お客様への商品提供を行うため、外貨を含めた流動性リスク、相場変動に起因する市場リスク、取引先や発行体に対する信用リスク、ヘッジが機能しないリスクの

ほか、業務を執行する上で必然的に発生するオペレーショナル・リスクや意思決定にモデルを活用することによるモデルリスク等が生じます。また、成長投資を実行することに伴い、投資先の業績や信用状態の悪化、市場環境の変化等に起因する投資リスクも発生します。そのため、フォワードルッキングな視点でグループ内における資本や流動性に与える影響を計測する統合リスク管理を行っています。

これらのリスクを統合的に管理するため、リスクアペタイト・フレームワークの下、当社グループが中心となり、リスクガバナンス態勢を整備しております。その際、当社グループの執行役会の分科会であるグループリスクマネジメント会議が子会社のリスク管理態勢やリスクの状況をモニタリングし、グループ全体のリスク管理の強化を図ることとしております。

グループリスクマネジメント会議の内容については、開催の都度、監査委員会へ報告を行っております。



また、リスクアペタイト・フレームワークに基づいて当社グループ全体のリスク管理を行う上で、取締役会の承認のもと、リスク管理の基本方針を「リスク管理規程」に定め、次の通り基本方針を明らかにしております。

(リスク管理の基本方針)

- (1) リスク管理への経営の積極的な関与
- (2) 当社グループの保有するリスクの特性に応じたリスク管理態勢の整備
- (3) 統合的なリスク管理に基づくリスク総体の把握と自己資本の充実及び流動性に係る健全性の確保
- (4) リスク管理プロセスの明確化

さらに、リスクを以下のように定義し、各リスクを管理する執行役及び所管部署を設置の上、リスク管理態勢を敷いています。

(リスクの定義)

(1) 市場リスク

金利、外国為替レート、株価などの市場で取引される商品の価格やレートが変化することによって、保有する金融商品又は金融取引により損失を被るリスク及び市場の流動性の著し

い低下により市場における取引が成立せず、又は著しく不利な条件での取引を余儀なくされることにより、損失を被るリスクをいいます。

(2) 信用リスク

金融取引の取引先や保有する金融商品の発行体のデフォルト、或いは信用力の変化によって損失を被るリスクをいいます。

(3) 流動性リスク

市場環境の変化、当社グループ及び関係会社の財務内容の悪化等により資金繰りに支障をきたす、或いは通常よりも著しく高い資金調達コストを余儀なくされるリスクをいいます。

(4) オペレーショナル・リスク

内部プロセス・人・システムが不適切であることもしくは機能しないこと、又は外生的事象が生起することから生じる損失に係るリスクをいいます。

(5) モデルリスク

モデルの開発、実装における誤り、又はモデルの誤用に起因して、当社グループが損失を被るリスクをいいます。

(6) 投資リスク

投資先の業績や信用状態の悪化、市場環境の変化等により、当社グループが行う投資の価値が毀損する、或いは追加の資金拠出が必要となるリスクや、投資から得られる収益が期待を下回るリスクをいいます。

(7) レピュテーション・リスク

会社、役職員の行動が、対外的にネガティブな印象を与えることにより、顧客並びに利益を喪失するリスクをいい、ディスクロージャーに関わるものを含みます。

(8) 会計・税務リスク

会計における基準・法令諸規則等に照らし適正な処理・開示が行われないリスク、税務における基準・法令諸規則等に照らし適正な申告・納付が行われないリスク、又はそれらに伴い損失を被るリスクをいいます。

なお、当社グループでは、各リスクを管理する執行役及び部署、リスク管理に係る方針及び具体的な施策を審議・決定する会議体を、リスクの区分に応じ、以下の通りとしております。

リスク・カテゴリー	執行役	所管部署	会議体
市場リスク	CRO	リスクマネジメント部	グループリスクマネジメント会議
信用リスク	CRO	リスクマネジメント部	グループリスクマネジメント会議
流動性リスク	CRO	リスクマネジメント部	グループリスクマネジメント会議
オペレーショナル・リスク	CRO	リスクマネジメント部	グループリスクマネジメント会議
モデルリスク	CRO	リスクマネジメント部	グループリスクマネジメント会議
投資リスク	CRO	リスクマネジメント部	グループリスクマネジメント会議
レピュテーション・リスク	広報担当執行役 IR室を管轄する執行役 コンプライアンス担当執行役	広報部 IR室 コンプライアンス統括部	ディスクロージャー委員会
会計・税務リスク	CFO	財務部	グループリスクマネジメント会議

（3つの防衛線）

さらに、当社グループは、実効的なリスクガバナンス態勢を構築するため、「3つの防衛線」に係るガイドラインを定め、リスク管理の枠組みを整備しております。

「3つの防衛線」とは、リスク管理における機能と役割・責任を明確にし、健全な管理を行う考え方であり、「第1の防衛線」は自律的リスク管理、「第2の防衛線」は全社的リスク管理、「第3の防衛線」は内部監査の機能を有しております。



4. 信用リスクに関する事項

イ) リスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要

当社グループのトレーディング業務における信用リスクには取引先リスクと発行体リスクがあります。

取引先リスクについては、当社グループが一取引先グループに対して許容できる与信相当額の上限を設定し、定期的にモニタリングしております。加えて、取引先リスク全体のリスク量を計測しています。また、マーケットメイクにより保有する金融商品の発行体リスクについてもリスク量をモニタリングしています。

当社グループは、商品提供や資産運用・投資を行うことに伴い、様々な商品・取引のエクスポージャーが特定の取引先グループに集中するリスクがあります。当該取引先グループの信用状況が悪化した場合、大幅な損失が発生する可能性があるため、一取引先グループに対するエクスポージャーの合計に対し限度額を設定し、定期的にモニタリングしています。

また、当社グループは信用リスクの適切な管理を行う体制となっています。リスク管理部署は、計測した与信相当額等を日次で経営陣に報告するとともに、取引先の審査や与信枠の設定、リスク量の計測、信用リスク状況のモニタリングを行い、グループリスクマネジメント会議への報告等を行っています。

ロ) 会計上の引当て及び償却に関する基準の概要

貸付金等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法、キャッシュ・フロー見積法により計上しております。

また銀行子会社においては、「銀行等金融機関の資産の自己査定並びに貸倒償却及び貸倒引当金の監査に関する実務指針」（日本公認会計士協会銀行等監査特別委員会報告第4号 2022年4月14日）に規定する正常先債権に相当する債権については、一定の種類毎に分類し、予想損失率等に基づき計上しております。すべての債権は、資産の自己査定基準に基づき、営業関連部署及び審査所管部署が資産査定を実施しております。

ハ) 標準的手法を採用した場合における、エクスポージャーの種類ごとのリスク・ウェイトの判定に使用する適格格付機関等の名称

当社グループは信用リスク・アセットの算出にあたっては「標準的手法」を採用しており、リスク・ウェイトの判定において次の格付機関を採用しております。

株式会社格付投資情報センター

株式会社日本格付研究所

ムーディーズ・インベスターズ・サービス

S&P グローバル・レーティング

5. 信用リスク削減手法に関するリスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要（派生商品取引及びレポ形式の取引等に関連して用いられる信用リスク削減手法を除く）

イ) ネットティングを利用する方針及びプロセスの基本的な特徴並びにネットティングの利用状況に係る説明

証券担保ローンにおいては、担保として受入れた有価証券の時価の範囲内の借入上限額まで貸付を行っており、貸付後は、貸付額と担保評価額をネットティングするとともに、貸付額の担保評価額に対する比率の悪化に応じて追加担保の差入を依頼しています。それでも改善されない場合には担保処分等により債権の保全を図ります。

ロ) 担保評価・担保管理の方針・プロセスの基本的な特徴

債権保全の手段として主に担保を利用しており、担保の種類は原則として現金や流動性の高い有価証券となっています。それぞれ担保の信用力や流動性を考慮して、適格な担保の種類や評価掛目を設定しております。

また、担保は日次で時価評価し、エクスポージャーの変動をモニタリングしています。

ハ) 使用する信用リスク削減手法におけるマーケット・リスク又は信用リスクの集中状況に関する説明

担保である有価証券の価格は変動するため、当該変動性を考慮して評価掛目を設定しています。また、各取引先から受入れる同一株式については、受入担保株数に上限等を設定し、集中の防止を図っております。

6. 派生商品取引及びレポ形式の取引等の相手方に対する信用リスク（カウンターパーティ信用リスク）に関するリスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要（カウンターパーティ信用リスクの削減手法に関するものを含む）

イ) カウンターパーティ及び中央清算機関に対するエクスポージャーに関するリスク資本及び与信限度枠の割当方法に関する方針

派生商品取引及びレポ形式の取引においては、事前取引相手の審査が行われ、信用状況等を確認できた場合に限り与信枠が付与されます。取引が継続している間は、日次でエクスポージャーと担保時価が計算・比較され、必要に応じて担保の授受が行われています。

長期決済期間取引についても同様に、事前の審査により、与信枠が付与された相手のみが取引可能となっています。これらの取引先の与信枠は定期的に見直しが行われています。

ロ) 担保、保証、ネットティングその他の信用リスク削減手法に関する評価並びに担保等の管理の方針及び処分手続の概要

債権保全の手段として主に担保を利用しており、担保の種類は原則として現金や流動性の高い有価証券となっています。それぞれ担保の信用力や流動性を考慮して、適格な担保の種類や評価掛目を設定しております。

担保は日次で時価評価し、エクスポージャーの変動をモニタリングしています。取引先が債務不履行等となった場合には、担保を市場で売却し債権保全を図ります。

担保で保全されていない部分のエクスポージャーについては、シミュレーションで計算した将来の期待エクスポージャーと市場で観測される CDS スプレッドに基づき引当金を計算しています。

派生商品取引及びレバ取引では、原則として相対ネットリング契約（ISDA マスター契約等）や担保契約（ISDA CSA 契約等）を締結しており、法的な有効性を確認できる相対ネットリング契約については信用リスク削減手法を適用しております。信用リスク削減手法については「包括的手法」を採用しております。

ハ) 自社の信用力悪化により担保を追加的に提供することが必要となる場合の影響度に関する説明

自社の信用力の悪化により追加的に担保を提供する必要が生じますが、その金額はモニタリングの対象となっており、問題ない水準です。

7. 証券化取引に係るリスクに関する事項

イ) リスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要

当社グループは主に投資家として証券化取引に関与しており、投資業務、銀行業務及びトレーディング業務において証券化商品を保有しております。証券化商品には、市場リスクや信用リスクに加え、裏付資産、優先劣後構造、ストラクチャーに関するリスクなどがあり、独立した部署が、保有残高や信用状況について定期的なモニタリングを実施しております。

ロ) 連結自己資本規制比率告示第 226 条第 1 項第 1 号から第 4 号まで（連結自己資本規制比率告示第 280 条の 2 第 2 項において準用する場合を含む。）に規定する体制の整備及びその運用状況の概要

証券化エクスポージャーの包括的なリスク特性、その裏付資産に関する包括的なリスク特性及びパフォーマンスに係る情報、証券化取引についての構造上の特性等を把握するため、規程に基づき定期的に証券化エクスポージャーに関する情報をモニタリングしています。

ハ) 証券化目的導管体を用いて第三者の資産に係る証券化取引を行った場合の当該証券化目的導管体の名称及び当該証券化取引に係る証券化エクスポージャーを保有しているかどうかの別並びに会社グループの子法人等（連結子法人等を除く）及び関連法人等のうち、当該会社グループが行った証券化取引（当該会社グループが証券化目的導管体を用いて行った証券化取引を含む）に係る証券化エクスポージャーを保有し、かつ、当該会社グループがその経営に関与し又は助言を提供しているものの名称

該当ありません。

ニ) 契約外の信用補完等を提供している証券化目的導管体の名称及び当該証券化目的導管体ごとの当該契約外の信用補完等による自己資本への影響

該当ありません。

ホ)証券化取引に関する会計方針

証券化取引に関する金融資産及び金融負債の発生及び消滅の認識、その評価及び会計処理については、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号)等に準拠しております。

ヘ)証券化エクスポージャーの種類ごとのリスク・ウェイトの判定に使用する適格格付機関の名称

証券化エクスポージャーに関するリスク・ウェイトの判定において次の格付機関を採用しております。

株式会社格付投資情報センター

株式会社日本格付研究所

ムーディーズ・インベスターズ・サービス

S&P グローバル・レーティング

ト)内部評価方式を用いている場合には、その概要

該当ありません。

7の2. CVA リスクに関する事項

イ)CVA リスク相当額の算出に使用する手法 (SA-CVA、完全な BA-CVA 又は限定的な BA-CVA をいう。)の名称及び各手法により算出される対象取引の概要

当社グループでは、派生商品取引における取引相手方の信用リスクに対する時価調整 (CVA) を計測・管理しています。CVA リスク相当額の算出は、CVA 計測モデルを用いて財務会計上の CVA 額を計算している派生商品取引に対しては SA-CVA、その他については限定的な BA-CVA を使用しています。

ロ)CVA リスクの特性及び CVA に関するリスク管理体制の概要 (CVA リスクのヘッジ方針及びヘッジの継続的な有効性を監視するための体制を含む。)

CVA は取引相手方の信用力や市場の変動に伴う変動リスクがあります。SA-CVA を用いるエンティティでは CVA デスクを設置し、変動リスクのモニタリングやヘッジオペレーションによるリスクコントロールを行っています。

ハ)CVA に関するリスク管理体制の概要 (取締役等の関与の仕組みを含む。)及び管理体制が有効に機能するための経営管理体制の概要 (CVA に関するリスク管理の状況を示す書類の作成及び報告の状況並びに CVA エクスポージャー計測モデル検証部署の関与状況並びに内部監査部署の関与状況を含む。)

当社グループにおける CVA リスク管理体制としては、大和証券グループ本社リスク管理規程に基づき、CVA の変動リスクを市場リスク管理の枠組みにおいて管理しています。リスク担当部署及びフロント部署が損失限度額等のリミット設定やモニタリングを行い、リスク状況はリスクマネジメント会議等を通じて CRO や取締役等へ定期報告されます。

SA-CVA の計測に用いる CVA 計測モデルについては、モデルの開発時・変更時の検証に加え、年に 1 回以上の定期検証がモデル開発部署とは独立した検証部署にて行われます。また SA-CVA 計測や CVA リスク管理体制につき、内部監査部により年に 1 回以上の監査が行われます。

8. マーケット・リスクに関する事項

イ) リスク管理の方針、手続及び体制の概要

(1) リスクの特定、評価、管理及び削減に係る方法並びにヘッジの有効性に係る監視の方法

当社グループのトレーディング業務では、市場流動性を提供することで対価を得るとともに、一定の金融資産等の保有を通じてマーケット・リスクを負っています。当社グループでは、損益変動の抑制のために適宜ヘッジを実施していますが、ストレス時にはヘッジが有効に機能しなくなる可能性があるため、財務状況や対象部門のビジネスプラン・予算等を勘案した上で、VaR（一定の信頼水準のもとでの最大予想損失額）及び各種ストレス・テストによる損失見積りが自己資本の範囲内に収まるように、それぞれ限度枠を設定しています。その他、ポジション、感応度等にも限度枠を設定しております。

また、当社グループでは、トレーディング業務を担当する部門において、自らの市場リスクを把握する目的でポジションや感応度を算出しモニタリングを行っている一方で、リスク管理部署においても、グループ全体の市場リスクの状況をモニタリングし、設定された限度枠内であるかどうかを確認の上、経営陣に日次で報告しております。

(2) トレーディング勘定に分類する商品の範囲を定めるための方針及び手続（低流動性ポジションの特定、管理及び監視に係る方法を含む。）

連結自己資本規制比率告示に従い、短期間の再売却目的や相場その他の指標にかかる短期の価格変動からの利益の獲得などを目的とする商品およびトレーディング勘定に分類すると定められている商品（ただし、一部商品については、金融庁長官に届出を行いバンキング勘定に分類）についてはトレーディング勘定に分類しています。

(3) トレーディング勘定とバンキング勘定との間の商品の振替を行った場合には、次に掲げる事項

(i) 当該振替を行った商品の市場価値及びグロスの公正価値

(ii) 当該振替の理由

トレーディング勘定とバンキング勘定との間の商品の振替は行っておりません。

(4) 内部取引担当デスクのリスク移転の状況

内部取引担当デスクは設置しておりません。

ロ) 報告及び計測に係るシステムの範囲並びにその内容

マーケット・リスク相当額の計測に際しては、トレーディング勘定に分類する全商品とバンキング勘定の商品に係る外国為替リスクおよびコモディティ・リスクに対して標準的手法を適用しています。

9. オペレーショナル・リスクに関する事項

イ) リスク管理の方針及び手続の概要

業務の高度化・多様化、システム化の進展等に伴い様々なリスクが生じており、オペレーショナル・リスク管理の重要性は年々高まっています。

当社グループの主要なグループ各社では、当社グループのオペレーショナル・リスク管理に関する規程に基づき、下記の枠組みにより適切なオペレーショナル・リスク管理を行っております。加えて、権限の厳正化、人為的ミス削減のための事務処理の機械化、業務マニュアルの整備等の必要な対策を講じており、グループ各社の事業特性に応じたオペレーショナル・リスクの削減に努めております。

＜オペレーショナル・リスク管理の枠組み＞

当社グループはオペレーショナル・リスク管理の枠組みとして、RCSA（リスク・コントロール・セルフ・アセスメント）を実施しております。RCSAとは、業務の実施者自らがオペレーショナル・リスクの特定・把握・評価を行い、発生頻度、影響度からリスクを分析し、リスク軽減策等の有効性を評価、検証するプロセスです。RCSAはグループの主要な会社で定期的実施しており、実施結果はグループリスクマネジメント会議で報告されます。

ロ) BI の算出方法

事業規模指標（BI）については、連結自己資本規制比率告示第 283 条に基づき、金利要素（ILDC）、役務要素（SC）および金融商品要素（FC）を合計して算出しています。

ハ) ILM の算出方法

当社グループの ILM の算出においては、連結自己資本規制比率告示第 284 条第 1 項第 1 号に定める方法を採用しています。

ただし、第 288 条第 1 号に定める基準に適合していない連結子法人等については、第 284 条第 1 項第 4 号に定める、ILM に 1 を下限とする保守的な見積値を用いる方法を採用しています。

ニ) オペレーショナル・リスク相当額の算出に当たって、BI の算出から除外した事業部門の有無（事業部門を除外した場合にあっては、その理由を含む。）

該当ございません。

ホ) オペレーショナル・リスク相当額の算出に当たって、ILM の算出から除外した特殊損失の有無（特殊損失を除外した場合にあっては、その理由を含む。）

該当ございません。

10. 信用リスク・アセットの額の算出対象となっている株式及び連結自己資本規制比率 告示第43条第2項に規定する株式と同等の性質を有するものに対するエクスポージャー又は株式等エクスポージャーに関するリスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要

イ) リスクを確実に認識し、評価・計測し、報告するための体制

当社グループはトレーディング業務以外にも、投資業務、銀行業務、取引関係上の目的等の投資有価証券等において、株式及び株式と同等の性質を有するものに対するエクスポージャー又は株式等エクスポージャーを保有しています。各業務において特有のリスク特性があるため、それらに応じた市場リスク管理、信用リスク管理等の枠組みに基づきリスク量を計測する等適切な方法でリスク管理を行い、グループリスクマネジメント会議に報告しております。

ロ) その他有価証券、子会社株式及び関連会社株式の区分ごとのリスク管理の方針

当社グループが出資する子会社については当該子会社の資産・負債等を、関連会社については当該関連会社に対する当社グループの出資等をリスク管理の対象とし、管理区分に応じた適切なリスク管理を行っております。

ハ) 株式等エクスポージャーの評価等重要な会計方針

その他有価証券の市場価格のあるものについては連結決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は主として移動平均法により算定)、市場価格のない株式等(非上場株式等)並びに組合出資金等については移動平均法による原価法で計上しております。

11. 金利リスクに関する事項

イ) リスク管理の方針及び手続の概要

当社グループにおけるトレーディング業務以外の取引から生じる金利リスクについては、市場リスク管理の中で、経済価値の変動及び期間収益の変動を算出しております。算出結果は、グループリスクマネジメント会議において報告を行っております。

ロ) 金利リスクの算定手法の概要

主要な子会社及び大和証券グループ本社の保有する金融資産及び金融負債を対象として、四半期ごとに一定のストレスを想定した金利変動のショックシナリオに基づき、経済価値の変動及び期間収益の変動を算出しております。

12. 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	3,790,154	3,791,633	
預託金	560,091	560,091	
受取手形、売掛金及び契約資産	38,211	38,211	
有価証券 (a)	2,140,789	2,140,789	8, 18, 39, 54, 72, 73
トレーディング商品 (b)	12,391,655	12,391,655	16, 18, 39, 54, 72, 73
約定見返勘定	-	-	
営業投資有価証券 (c)	123,170	123,170	18, 39, 54, 72, 73
投資損失引当金	▲ 105	▲ 105	
営業貸付金	3,610,598	3,610,598	
仕掛品	861	861	
信用取引資産	308,051	308,051	
有価証券担保貸付金	12,152,689	12,152,689	
立替金	48,056	48,056	
短期貸付金	654	654	
未収収益	126,786	126,955	
繰延税金資産 (d)	-	-	10, 75
その他の流動資産	942,135	942,628	
貸倒引当金	▲ 14,254	▲ 14,254	
流動資産計	36,219,548	36,221,689	
固定資産			
有形固定資産	977,957	977,962	
無形固定資産	154,732	154,778	
のれん (e)	16,101	16,101	8
のれん以外 (f)	138,631	138,676	9
投資その他の資産	725,408	725,035	
投資有価証券 (g)	673,079	672,662	8, 18, 39, 54, 72, 73
繰延税金資産 (h)	7,370	7,374	10, 75
上記以外	44,958	44,998	
固定資産計	1,858,097	1,857,776	
繰延資産計	-	-	
資産の部合計	38,077,646	38,079,465	

(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	8,131	8,131	
トレーディング商品	8,760,742	8,760,742	
約定見返勘定	970,944	970,944	
信用取引負債	43,399	43,399	
有価証券担保借入金	13,808,404	13,808,404	
銀行業における預金	5,042,025	5,042,025	
預り金	659,605	659,616	
受入保証金	495,268	495,268	
短期借入金	2,033,926	2,035,226	
コマーシャルペーパー	396,500	396,500	
1年内償還予定の社債	459,397	459,397	
未払法人税等	51,377	51,382	
繰延税金負債	-	-	
賞与引当金	56,580	56,580	
その他の流動負債	193,597	193,988	
固定負債			
社債	1,031,024	1,031,024	
長期借入金	1,850,739	1,850,739	
繰延税金負債	60,399	60,399	
退職給付に係る負債	43,978	43,978	
訴訟損失引当金	362	362	
負ののれん	-	-	
その他の固定負債	57,154	57,280	
特別法上の準備金	8,276	8,276	
負債の部合計	36,031,836	36,033,669	
純資産の部			
株主資本			
資本金 (i)	247,397	247,397	1a
資本剰余金 (j)	266,538	266,538	1a
利益剰余金 (k)	1,121,416	1,121,200	2
自己株式 (l)	▲ 149,544	▲ 149,544	1c
自己株式申込証拠金 (m)	27	27	1c
株主資本合計	1,485,835	1,485,619	
その他の包括利益累計額			
その他有価証券評価差額金	80,264	80,264	
繰延ヘッジ損益 (n)	27,211	27,211	11
為替換算調整勘定	169,918	169,918	
退職給付に係る調整累計額	340	340	
その他の包括利益累計額 (o)	277,734	277,734	3
新株予約権 (p)	5,821	5,821	1b
非支配株主持分 (q)	276,419	276,621	34-35, 48-49
純資産の部合計	2,045,809	2,045,796	

13. 連結自己資本規制比率規制上のエクスポージャーの額と連結貸借対照表計上額との差異及びその要因に関する説明

差異の要因については、「定量的な開示項目」の「4. その他定量的な開示事項」における「【LI2】連結自己資本規制上のエクスポージャーの額と連結貸借対照表計上額との差異の主な要因」の注釈をご参照ください。

■ 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. 信用リスク（カウンターパーティ信用リスク及び証券化取引に係るリスクを除く）に関する事項

イ) 地域別・業種別・残存期間別エクスポージャーの区分ごとの期末残高及びそれらの主な種類別の内訳

【2026年3月末】

(単位 百万円)

		エクスポージャーの額			
			貸出金	有価証券	その他
	日本	9,761,926	2,336,044	2,225,801	5,200,080
	海外	837,399	180,377	177,706	479,315
	地域別合計	10,599,325	2,516,422	2,403,508	5,679,395
	ソブリン	6,194,911	1,708,485	1,431,493	3,054,933
	金融機関	1,080,461	260	69,265	1,010,935
	法人	910,162	351,600	357,039	201,523
	個人	385,973	385,062	－	910
	CCP	23,816	－	－	23,816
	その他	2,004,000	71,013	545,710	1,387,276
	業種別合計	10,599,325	2,516,422	2,403,508	5,679,395
	1年以下	2,460,889	2,079,653	338,349	42,886
	1年超3年以下	241,342	1,808	233,652	5,882
	3年超5年以下	410,221	－	405,813	4,407
	5年超7年以下	44,370	－	40,919	3,451
	7年超	659,224	－	642,422	16,801
	期間の定めのないもの	6,783,277	434,960	742,350	5,605,966
	残存期間別合計	10,599,325	2,516,422	2,403,508	5,679,395

ロ)連結自己資本規制比率告示第 183 条第 1 項第 1 号から第 4 号までに掲げる事由が生じた債務者のエクスポージャーの期末残高、当該期末残高に対応して計上されている引当金の額及び当該エクスポージャーに係る償却額並びに地域別・業種別の内訳

(単位 百万円)

		2026年3月末		
		期末残高	引当金の額	償却額
	日本	70,810	17,358	-
	海外	5,923	185	-
地域別合計		76,734	17,543	-
	ソブリン	-	-	-
	金融機関	48	-	-
	法人	66,532	9,919	-
	個人	21	5	-
	CCP	-	-	-
	その他	10,131	7,617	-
業種別合計		76,734	17,543	-

ハ) 延滞期間別のエクスポージャーの期末残高

(単位 百万円)

		延滞エクスポージャー				
			1ヵ月未満	1ヵ月以上 2ヵ月未満	2ヵ月以上 3ヵ月未満	3ヵ月以上
	日本	51,392	36	4	409	50,941
	海外	65	-	-	-	65
地域別合計		51,458	36	4	409	51,007
	ソブリン	-	-	-	-	-
	金融機関	48	-	-	-	48
	法人	48,436	-	-	-	48,436
	個人	467	36	4	409	15
	CCP	-	-	-	-	-
	その他	2,506	-	-	-	2,506
業種別合計		51,458	36	4	409	51,007

二)経営再建又は支援を図ることを目的として貸出条件の緩和を実施した債権に係る債務者のエクスポージャーの期末残高のうち、貸出条件の緩和を実施したことに伴い、当該エクスポージャーに係る引当金の額を増加させたものの額及びそれ以外のものの額

該当ありません。

3. 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(レック・スルー方式)	716,902
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)	5,321
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%)	213
合計	722,437

4. 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	
		2026年 3月末	2025年 3月末	2026年 3月末	2025年 3月末
1	信用リスク	3,017,859	2,669,402	241,428	213,552
2	うち、標準的手法適用分	1,739,673	1,480,763	139,173	118,461
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	-	-	-	-
4	うち、スロッシング・クライテリア適用分	-	-	-	-
5	うち、先進的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	1,278,185	1,188,638	102,254	95,091
6	カウンターパーティ信用リスク	1,170,549	1,012,439	93,643	80,995
7	うち、SA-CCR適用分	337,040	349,838	26,963	27,987
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	40,238	29,213	3,219	2,337
9	その他	793,270	633,387	63,461	50,671
10	CVAリスク	115,489	99,244	9,239	7,939
	うち、SA-CVA適用分	89,558	77,898	7,164	6,231
	うち、完全なBA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、限定的なBA-CVA適用分	25,931	21,346	2,074	1,707
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	-	-	-	-
12	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算（リスク・スルー方式）	540,952	391,984	43,276	31,358
13	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）	12,827	7,479	1,026	598
	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%）	-	-	-	-
14	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%）	2,659	1,759	212	140
15	未決済取引	787	2,713	63	217
16	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	280,593	231,096	22,447	18,487
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-	-	-	-
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	242,877	196,520	19,430	15,721
19	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	37,715	34,576	3,017	2,766
20	マーケット・リスク	1,568,410	1,431,421	125,472	114,513
21	うち、標準的方式適用分	1,564,910	1,428,417	125,192	114,273
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
	うち、簡易的方式適用分	3,500	3,004	280	240
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	984,976	863,720	78,798	69,097
25	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	392,699	375,214	31,415	30,017
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	8,087,806	7,086,475	647,024	566,918

(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	
		2026年 3月末	2025年 12月末	2026年 3月末	2025年 12月末
1	信用リスク	3,017,859	2,832,673	241,428	226,613
2	うち、標準的手法適用分	1,739,673	1,559,804	139,173	124,784
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	-	-	-	-
4	うち、スロットティング・クライテリア適用分	-	-	-	-
5	うち、先進的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	1,278,185	1,272,869	102,254	101,829
6	カウンターパーティ信用リスク	1,170,549	1,112,815	93,643	89,025
7	うち、SA-CCR適用分	337,040	314,363	26,963	25,149
8	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	40,238	31,951	3,219	2,556
9	その他	793,270	766,500	63,461	61,320
10	CVAリスク	115,489	110,296	9,239	8,823
	うち、SA-CVA適用分	89,558	85,767	7,164	6,861
	うち、完全なBA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、限定的なBA-CVA適用分	25,931	24,528	2,074	1,962
11	経過措置により適用されるマーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	-	-	-	-
12	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（レック・スルー方式）	540,952	493,592	43,276	39,487
13	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）	12,827	15,743	1,026	1,259
	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%）	-	-	-	-
14	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%）	2,659	1,911	212	152
15	未決済取引	787	98	63	7
16	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	280,593	266,611	22,447	21,328
17	うち、内部格付手法準拠方式適用分	-	-	-	-
18	うち、外部格付準拠方式又は内部評価方式適用分	242,877	227,582	19,430	18,206
19	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	37,715	39,028	3,017	3,122
20	マーケット・リスク	1,568,410	1,350,900	125,472	108,072
21	うち、標準的方式適用分	1,564,910	1,347,425	125,192	107,794
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
	うち、簡易的方式適用分	3,500	3,474	280	277
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーショナル・リスク	984,976	929,506	78,798	74,360
25	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	392,699	392,099	31,415	31,367
26	フロア調整	-	-	-	-
27	合計	8,087,806	7,506,249	647,024	600,499

【LI1】 会計上の連結範囲と連結自己資本規制上の連結範囲との間の差異及び連結貸借対照表の区分と連結自己資本規制上のリスク・カテゴリーとの対応関係

LI1 その1

(単位 百万円)

		連結貸借対照 表計上額	連結自己資本 規制上の 連結範囲に 基づく連結 貸借対照表 計上額	各項目に対応する帳簿価額					所要自己資本 算定対象 外の項目又 は規制資本 からの調整 項目
				信用リスク	カウンター パーティ信 用リスク	証券化エク スポー ジャー	マーケット・ リスク		
	資産								
1	現金・預金	3,790,154	3,791,633	3,791,633	-	-	358,863	-	
2	預託金	560,091	560,091	560,091	-	-	25,886	-	
3	受取手形及び売掛金	38,211	38,211	38,211	-	-	38	-	
4	有価証券	2,140,789	2,140,789	2,002,409	-	141,391	906,308	-	
5	トレーディング商品	12,391,655	12,391,655	5	4,313,539	-	12,392,950	▲ 1,301	
6	約定見返勘定	-	-	-	-	-	6,427	-	
7	営業投資有価証券	123,170	123,170	104,539	-	-	88,208	-	
8	投資損失引当金	▲ 105	▲ 105	▲ 105	-	-	-	-	
9	営業貸付金	3,610,598	3,610,598	2,540,780	-	1,067,024	887,632	2,793	
10	仕掛品	861	861	861	-	-	-	-	
11	信用取引資産	308,051	308,051	-	308,051	-	-	-	
12	有価証券担保貸付金	12,152,689	12,152,689	-	13,755,428	-	6,372,045	-	
13	立替金	48,056	48,056	48,053	-	-	74	-	
14	短期貸付金	654	654	654	-	-	178	-	
15	未収収益	126,786	126,955	123,559	-	-	52,724	-	
16	繰延税金資産	-	-	-	-	-	-	-	
17	その他の流動資産	942,135	942,628	516,604	102,156	-	96,392	3,369	
18	貸倒引当金	▲ 14,254	▲ 14,254	▲ 14,102	-	-	▲ 185	-	
19	流動資産計	36,219,548	36,221,689	9,713,198	18,479,176	1,208,416	21,187,544	4,862	
20	有形固定資産	977,957	977,962	977,962	-	-	20,911	-	
21	無形固定資産	154,732	154,778	-	-	-	6,386	154,778	
22	のれん	16,101	16,101	-	-	-	1,673	16,101	
23	のれん以外	138,631	138,676	-	-	-	4,713	138,676	
24	投資その他の資産	725,408	725,035	667,230	476	3,017	125,411	4	
25	投資有価証券	673,079	672,662	617,853	-	3,017	119,820	-	
26	繰延税金資産	7,370	7,374	7,370	-	-	2,711	4	
27	上記以外	44,958	44,998	42,006	476	-	2,880	-	
28	固定資産計	1,858,097	1,857,776	1,645,192	476	3,017	152,710	154,782	
29	繰延資産計	-	-	-	-	-	-	-	
30	資産合計	38,077,646	38,079,465	11,358,390	18,479,652	1,211,433	21,340,254	159,644	

(注1)「信用リスク」の項目では、「カウンターパーティ信用リスク」及び「証券化エクスポージャー」に該当する額を除いた金額を記載しております。

(注2)「証券化エクスポージャー」の項目では、「マーケット・リスク」に該当する額を除いた金額を記載しております。

		連結貸借対照 表計上額	連結自己資本 規制上の 連結範囲に 基づく連結 貸借対照表 計上額	各項目に対応する帳簿価額					所要自己資本 算定対象 外の項目又は 規制資本 からの調整 項目
				信用リスク	カウンター パーティ信用 リスク	証券化エク スポー ジャー	マーケット・ リスク		
	負債								
31	支払手形及び買掛金	8,131	8,131	-	-	-	130	8,131	
32	トレーディング商品	8,760,742	8,760,742	-	5,054,548	-	8,760,742	-	
33	約定見返勘定	970,944	970,944	-	14,363	-	91,080	25,218	
34	信用取引負債	43,399	43,399	-	43,399	-	-	-	
35	有価証券担保借入金	13,808,404	13,808,404	-	15,411,143	-	9,726,641	-	
36	銀行業における預金	5,042,025	5,042,025	-	-	-	-	5,042,025	
37	預り金	659,605	659,616	-	-	-	123,233	659,616	
38	受入保証金	495,268	495,268	-	12,912	-	604	495,268	
39	短期借入金	2,033,926	2,035,226	-	-	-	228,517	2,035,226	
40	コマーシャルペーパー	396,500	396,500	-	-	-	-	396,500	
41	1年以内償還予定の社債	459,397	459,397	-	-	-	-	459,397	
42	未払法人税等	51,377	51,382	-	-	-	1,083	51,382	
43	繰延税金負債	-	-	-	-	-	-	-	
44	賞与引当金	56,580	56,580	-	-	-	22,738	56,580	
45	その他の流動負債	193,597	193,988	2,217	18,890	-	84,662	177,617	
46	社債	1,031,024	1,031,024	-	-	-	40,375	1,031,024	
47	長期借入金	1,850,739	1,850,739	-	-	-	48,603	1,850,739	
48	繰延税金負債	60,399	60,399	-	-	-	13	60,024	
49	退職給付に係る負債	43,978	43,978	-	-	-	-	43,978	
50	訴訟損失引当金	362	362	-	-	-	-	362	
51	負ののれん	-	-	-	-	-	-	-	
52	その他の固定負債	57,154	57,280	-	-	-	14,676	54,783	
53	特別法上の準備金	8,276	8,276	-	-	-	-	8,276	
54	負債合計	36,031,836	36,033,669	2,217	20,555,257	-	19,143,104	12,456,155	

(注1)「信用リスク」の項目では、「カウンターパーティ信用リスク」及び「証券化エクスポージャー」に該当する額を除いた金額を記載しております。

(注2)「証券化エクスポージャー」の項目では、「マーケット・リスク」に該当する額を除いた金額を記載しております。

【L12】 連結自己資本規制上のエクスポージャーの額と連結貸借対照表計上額との差異の主な要因

(単位 百万円)

		合計	対応する項目			
			信用リスク	カウンター パーティ 信用リスク	証券化 エクスポ ージャー	マーケット・ リスク
1	連結自己資本規制上の連結範囲に基づく資産の額	37,919,821	11,358,390	18,479,652	1,211,433	21,340,254
2	連結自己資本規制上の連結範囲に基づく負債の額	23,577,514	2,217	20,555,257	-	19,143,104
3	連結自己資本規制上の連結範囲に基づく資産及び負債の純額	14,342,306	11,356,173	▲ 2,075,605	1,211,433	2,197,150
4	オフ・バランスシートの額	111,216	111,216	-	-	-
5	デリバティブ取引等による差異	2,134,595	-	2,134,595	-	-
6	レボ取引等による差異	4,895,723	-	4,895,723	-	-
7	その他の差異	▲ 1,678,327	▲ 285,091	247,071	12,846	-
8	連結自己資本規制上のエクスポージャーの額	19,805,514	11,182,299	5,201,785	1,224,280	2,197,150

(注1)「信用リスク」の項目では、「カウンターパーティ信用リスク」及び「証券化エクスポージャー」に該当する額を除いた金額を記載しております。

(注2)「証券化エクスポージャー」の項目では、「マーケット・リスク」に該当する額を除いた金額を記載しております。

(注) 差異の主な要因は以下の通りです。

- トレーディング勘定のうち、デリバティブ取引については、資産と負債との間で一定の要件の下でネットティングがなされたものが、カウンターパーティ信用リスクとマーケット・リスクに跨ってエクスポージャーとして計上されております。
- 有価証券担保貸付金（レボ形式等取引）については、（負債の）有価証券担保借入金との間で一定の要件の下でネットティングされたものがエクスポージャーとして計上されております。
- オフバランス取引のうち、信用リスクに係るエクスポージャーとして計上されている対象があります。

【ENC1】担保資産の状況

(単位 百万円)

		担保に供さ れている資 産の額	担保に供さ れていない 資産の額	合計	うち、証券化 エクスポー ジャーの額
1	現金・預金	8,561	3,783,072	3,791,633	-
2	預託金	-	560,091	560,091	-
3	受取手形及び売掛金	-	38,211	38,211	-
4	有価証券	369,511	1,771,278	2,140,789	141,391
5	トレーディング商品	440,605	11,951,049	12,391,655	-
6	約定見返勘定	-	-	-	-
7	営業投資有価証券	-	123,170	123,170	-
8	投資損失引当金	-	▲ 105	▲ 105	-
9	営業貸付金	1,688,511	1,922,086	3,610,598	1,067,024
10	仕掛品	-	861	861	-
11	信用取引資産	-	308,051	308,051	-
12	有価証券担保貸付金	-	12,152,689	12,152,689	-
13	立替金	-	48,056	48,056	-
14	短期貸付金	-	654	654	-
15	未収収益	-	126,955	126,955	-
16	繰延税金資産	-	-	-	-
17	その他の流動資産	34,376	908,252	942,628	-
18	貸倒引当金	-	▲ 14,254	▲ 14,254	-
19	有形固定資産	-	977,962	977,962	-
20	無形固定資産	-	154,778	154,778	-
21	のれん	-	16,101	16,101	-
22	のれん以外	-	138,676	138,676	-
23	投資その他の資産	51,818	673,217	725,035	3,017
24	投資有価証券	51,818	620,844	672,662	3,017
25	繰延税金資産	-	7,374	7,374	-
26	上記以外	-	44,998	44,998	-
	合計	2,593,385	35,486,080	38,079,465	1,211,433

【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	37,743	2,495,424	16,746	2,516,422
2	有価証券（うち負債性のもの）	-	1,862,366	-	1,862,366
3	その他オン・バランスシートの資産（うち負債性のもの）	23,907	4,011,662	1,223	4,034,346
4	オン・バランスシートの資産の合計（1+2+3）	61,651	8,369,453	17,970	8,413,135
	オフ・バランスシートの資産				
5	支払承諾等	-	67,254	-	67,254
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）	-	67,254	-	67,254
	合計				
8	合計（4+7）	61,651	8,436,708	17,970	8,480,389

(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)

	前期末:2025年9月末 当期末:2026年3月末	額
1	前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	63,844
2	貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の当期中 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
4		償却された額
5		その他の変動額
6	当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)	61,651

(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	1,898,381	618,040	380,345	237,694	-
2	有価証券(負債性のもの)	1,709,474	152,892	-	152,892	-
3	その他オン・バランスシートの資産(負債性のもの)	4,032,440	1,906	77	1,828	-
4	合計 (1+2+3)	7,640,296	772,838	380,423	392,415	-
5	うちデフォルトしたもの	51,242	-	-	-	-

【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 均值(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		
1a	日本国政府及び日本銀行向け	4,918,843	-	4,918,843	-	-	-
1b	外国の中央政府及び中央銀行向け	422,862	-	422,862	-	1,973	0.47%
1c	国際決済銀行等向け	-	-	-	-	-	-
2a	我が国の地方公共団体向け	196,378	-	196,378	-	-	-
2b	外国の中央政府等以外の公共部門向け	35,017	-	35,017	-	6,596	18.84%
2c	地方公共団体金融機構向け	27,433	-	27,433	-	4,571	16.66%
2d	我が国の政府関係機関向け	549,864	-	549,864	-	31,394	5.71%
2e	地方三公社向け	0	-	0	-	0	20.00%
3	国際開発銀行向け	44,511	-	44,511	-	2,768	6.22%
4	金融機関、第一種金融商品取引業者及び保険会社向け	1,080,412	39,194	1,080,412	39,194	278,174	24.85%
	うち、第一種金融商品取引業者及び保険会社向け	33,864	-	33,864	-	11,819	34.90%
5	カバード・ボンド向け	-	-	-	-	-	-
6	法人等向け(特定貸付債権向けを含む。)	860,389	23,970	751,014	20,331	488,726	63.36%
	うち、特定貸付債権向け	15,062	1,005	15,062	402	18,490	119.56%
7a	劣後債権及びその他資本性証券等	-	-	-	-	-	-
7b	株式等	399,469	26,632	399,469	13,448	661,087	160.10%
8	中堅中小企業等向け及び個人向け	385,957	392,770	114,909	13,301	135,841	105.95%
	うち、トランザクター向け	-	-	-	-	-	-
9	不動産関連向け	53,512	5,209	53,512	2,083	54,186	97.46%
	うち、自己居住用不動産等向け	-	-	-	-	-	-
	うち、賃貸用不動産向け	39,007	-	39,007	-	29,861	76.55%
	うち、事業用不動産関連	1,354	-	1,354	-	1,472	108.72%
	うち、その他不動産関連	-	-	-	-	-	-
	うち、ADC向け	13,150	5,209	13,150	2,083	22,851	150.00%
10a	延滞等(自己居住用不動産等向けエクスポージャーを除く。)	51,242	-	51,242	-	74,352	145.10%
10b	自己居住用不動産等向けエクスポージャーに係る延滞	-	-	-	-	-	-
11a	現金	3	-	3	-	-	-
11b	取立未済手形	-	-	-	-	-	-
	信用保証協会等による保証付	-	-	-	-	-	-
	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	-	-	-	-	-	-
12	合計	9,025,899	487,776	8,645,476	88,359	1,739,673	19.92%

【CR5a】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

CR5a その1

(単位 百万円)

	リスク・ウェイト 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)				
		0%	20%	50%	100%	150%
1a	日本国政府及び日本銀行向け	4,918,843	-	-	-	-
1b	外国の中央政府及び中央銀行向け	404,115	4	15	100	1
1c	国際決済銀行等向け	-	-	-	-	-
		0%	10%	20%	50%	100%
2a	我が国の地方公共団体向け	196,378	-	-	-	-
2b	外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	4,073	30,944	-	-
2c	地方公共団体金融機構向け	-	9,154	18,278	-	-
2d	我が国の政府関係機関向け	251,681	282,417	15,765	-	-
2e	地方三公社向け	-	-	0	-	-
		0%	20%	30%	50%	100%
3	国際開発銀行向け	30,669	13,842	-	-	-
		20%	30%	40%	50%	75%
4	金融機関、第一種金融商品取引業者及び保険会社向け	824,761	243,745	8,153	13,772	-
	うち、第一種金融商品取引業者及び保険会社向け	17,426	9,242	3,769	644	-
		10%	15%	20%	25%	35%
5	カバード・ボンド向け	-	-	-	-	-
		20%	50%	75%	80%	85%
6	法人等向け(特定貸付債権向けを含む。)	95,632	190,423	98,614	-	-
	うち、特定貸付債権向け	-	-	-	-	-
		100%	150%	160%	220%	その他
7a	劣後債権及びその他資本性証券等	-	-	-	-	-
7b	株式等	-	-	410,982	1,935	-
		45%	75%	100%	その他	合計
8	中堅中小企業等向け及び個人向け	-	-	112,949	15,261	128,210

CR5a その2

(単位 百万円)

	リスク・ウェイト 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)				
		その他	合計			
1a	日本国政府及び日本銀行向け	-	4,918,843			
1b	外国の中央政府及び中央銀行向け	18,625	422,862			
1c	国際決済銀行等向け	-	-			
2a		150%	その他	合計		
	我が国の地方公共団体向け	-	-	196,378		
	外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	-	35,017		
	地方公共団体金融機構向け	-	-	27,433		
	我が国の政府関係機関向け	-	-	549,864		
2e	地方三公社向け	-	-	0		
3		150%	その他	合計		
	国際開発銀行向け	-	-	44,511		
4		100%	150%	その他	合計	
	金融機関、第一種金融商品取引業者及び保険会社向け	1,357	18,455	9,360	1,119,606	
	うち、第一種金融商品取引業者及び保険会社向け	101	2,420	260	33,864	
5		50%	100%	その他	合計	
	カバード・ボンド向け	-	-	-	-	
6		100%	130%	150%	その他	合計
	法人等向け(特定貸付債権向けを含む。)	286,865	10,083	302	89,424	771,345
	うち、特定貸付債権向け	5,381	10,083	-	-	15,465
7a		合計				
	劣後債権及びその他資本性証券等	-				
7b	株式等	412,917				
8	中堅中小企業等向け及び個人向け					

CR5a その3

(単位 百万円)

	リスク・ウェイト 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)				
9a		20%	25%	30%	40%	50%
	不動産関連向け うち、自己居住用不動産等向け	-	-	-	-	-
	うち、抵当権が第二順位以下で適格要件をみたすもの	-	-	-	-	-
9b		30%	35%	45%	60%	75%
	不動産関連向け うち、賃貸用不動産向け	322	359	2,496	3,444	25,180
	うち、抵当権が第二順位以下で適格要件をみたすもの	-	-	-	-	-
9c		70%	90%	110%	150%	その他
	不動産関連向け うち、事業用不動産関連	0	85	1,268	-	-
	うち、抵当権が第二順位以下で適格要件をみたすもの	-	-	-	-	-
9d		60%	その他	合計		
	不動産関連向け うち、その他不動産関連	-	-	-	-	-
	うち、抵当権が第二順位以下で適格要件をみたすもの	-	-	-	-	-
9e		100%	150%	その他	合計	
	不動産関連向け うち、ADC向け	-	15,234	-	15,234	-
10a		50%	100%	150%	その他	合計
	延滞等(自己居住用不動産等向けエクスポージャーを除く。)	2,510	-	48,731	0	51,242
10b	自己居住用不動産等向けエクスポージャーに係る延滞	-	-	-	-	-
11a		0%	10%	20%	その他	合計
	現金	3	-	-	-	3
11b	取立未済手形	-	-	-	-	-
	信用保証協会等による保証付	-	-	-	-	-
	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	-	-	-	-	-

CR5a その4

(単位 百万円)

	リスク・ウェイト 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)				
		70%	75%	その他	合計	
9a	不動産関連向け うち、自己居住用不動産等向け	-	-	-	-	
				その他	合計	
	うち、抵当権が第二順位以下で適格要件をみたすもの			-	-	
9b		105%	150%	その他	合計	
	不動産関連向け うち、賃貸用不動産向け	7,202	-	1	39,007	
				その他	合計	
9c				-	-	
	うち、抵当権が第二順位以下で適格要件をみたすもの					
		合計				
9d	不動産関連向け うち、事業用不動産関連	1,354				
		合計				
	うち、抵当権が第二順位以下で適格要件をみたすもの	-				
9e	不動産関連向け うち、その他不動産関連					
	うち、抵当権が第二順位以下で適格要件をみたすもの					
10a	延滞等(自己居住用不動産等向けエクスポージャーを除く。)					
10b	自己居住用不動産等向けエクスポージャーに係る延滞					
11a	現金					
11b	取立未済手形					
	信用保証協会等による保証付					
	株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付					

【CR5b】標準的手法-リスク・ウェイト区分別の信用リスク・エクスポージャーと CCF

(単位 百万円)

	リスク・ウェイト	オン・バランス シートのエク スポージャーの額	オフ・バランス シートのエク スポージャーの額	CCFの加重平均 値	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)
1	40%未満	7,290,392	39,194	100.00%	7,458,405
2	40%－70%	208,902	－	－	220,818
3	75%	123,794	－	－	123,794
	80%	－	－	－	－
4	85%	－	－	－	－
5	90%－100%	778,912	211,947	18.32%	401,358
6	105%－130%	18,152	1,005	40.00%	18,554
7	150%	206,275	208,997	10.75%	97,987
8	160%	397,533	26,632	50.50%	410,982
9	220%	1,935	－	－	1,935
10	1250%	－	－	－	－
11	合計	9,025,899	487,776	23.44%	8,733,835

【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	167,849	243,187		1.4	575,452	337,040
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					3,072,168	793,270
5	エクスポージャー変動推計モデル					-	-
6	合計						1,130,311

【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%	30%	40%
1	日本国政府及び日本銀行向け	1,863,825	-	-	-	-
2	外国の中央政府及び中央銀行向け	4,568	-	2,467	-	-
3	国際決済銀行等向け	78,174	-	-	-	-
4	我が国の地方公共団体向け	640	-	-	-	-
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	-	106,467	-	-
6	国際開発銀行向け	3,318	-	3,574	-	-
7	地方公共団体金融機構向け	-	-	3,120	-	-
8	我が国の政府関係機関向け	-	18,446	12,240	-	-
9	地方三公社向け	-	-	-	-	-
10	金融機関、第一種金融商品取引業者及び保険会社向け	-	-	92,632	446,744	49,335
11	法人等向け	-	-	7,436	-	-
12	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-	-	-
13	上記以外	-	-	-	-	-
14	合計	1,950,526	18,446	227,939	446,744	49,335

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%	80%	85%	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	-	-	-	-	-
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	1,706	-	-	-	-
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、第一種金融商品取引業者及び保険会社向け	58,468	-	-	-	1,581
11	法人等向け	3,896	10,174	-	-	850,817
12	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-	-	-
13	上記以外	-	-	-	-	9,838
14	合計	64,071	10,174	-	-	862,237

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)			
		130%	150%	その他	合計
1	日本国政府及び日本銀行向け	-	-	-	1,863,825
2	外国の中央政府及び中央銀行向け	-	-	-	7,035
3	国際決済銀行等向け	-	-	-	78,174
4	我が国の地方公共団体向け	-	-	-	640
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	-	-	108,173
6	国際開発銀行向け	-	-	-	6,892
7	地方公共団体金融機構向け	-	-	-	3,120
8	我が国の政府関係機関向け	-	-	-	30,686
9	地方三公社向け	-	-	-	-
10	金融機関、第一種金融商品取引業者及び保険会社向け	-	17,473	-	666,236
11	法人等向け	-	670	-	872,995
12	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-	-
13	上記以外	-	-	-	9,838
14	合計	-	18,144	-	3,647,621

【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)	18,042	218,975	47,555	417,010	5,703,272	4,964,962
2	現金(その他通貨)	4,097	67,516	3,634	11,268	10,639,171	9,101,978
3	国内ソブリン債	18,612	299,597	21,909	273	4,326,120	4,965,226
4	その他ソブリン債	15,555	3,078	-	-	6,842,358	7,220,430
5	政府関係機関債	758	135,977	-	-	1,160,388	3,447,884
6	社債	95,465	181,926	-	-	123,696	500,661
7	株式	78,499	-	-	27,924	1,036,780	904,631
8	その他担保	1,969	-	-	-	3,526	2,122,122
9	合計	233,001	907,070	73,099	456,477	29,835,314	33,227,898

(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	719,661	1,005,474
2	インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ	3,769,848	3,566,627
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	4,489,509	4,572,101
	公正価値		
7	プラスの公正価値(資産)	7,409	59,717
8	マイナスの公正価値(負債)	▲ 58,278	▲ 10,421

【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)		40,238
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。)	1,471,415	29,365
3	(i) 派生商品取引(上場以外)	356,795	7,155
4	(ii) 派生商品取引(上場)	660,888	13,217
5	(iii) レポ形式の取引	453,731	8,992
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	12,731	
8	分別管理されていない当初証拠金	40,459	809
9	事前拠出された清算基金	29,557	10,063
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）	562,262	-	562,262
2	担保付住宅ローン	243,711	-	243,711
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	318,550	-	318,550
5	再証券化	-	-	-
6	ホールセール（合計）	662,017	-	662,017
7	事業法人向けローン	650,146	-	650,146
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	11,871	-	11,871
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)	429	-	429
2	担保付住宅ローン	429	-	429
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	1,221,262	1,221,262	1,221,262	559,245	662,017
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	3,017	3,017	3,017	3,017	-
	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	1,221,262	1,221,262	1,221,262	559,245	662,017
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	3,017	3,017	3,017	3,017	-
	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	外部格付準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	242,877	242,877	242,877	110,611	132,266
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	37,715	37,715	37,715	37,715	-
	所要自己資本の額(算出方法別)					
14	内部格付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	-	-	-	-	-
15	外部格付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	19,430	19,430	19,430	8,848	10,581
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	3,017	3,017	3,017	3,017	-

SEC4 その2

(単位 百万円)

		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	-	-	-	-	-
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	外部格付準拠方式又は内部評価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	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-

SEC4 その3

(単位 百万円)

		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	-	-	-	-	-
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	外部格付準拠方式又は内部評価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	-	-	-	-	-
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)

		マーケット・リスク相当額
1	一般金利リスク	21,871
2	株式リスク	9,097
3	コモディティ・リスク	159
4	外国為替リスク	30,075
5	信用スプレッド・リスク(非証券化商品)	41,452
6	信用スプレッド・リスク(証券化商品(非CTP))	67
7	信用スプレッド・リスク(証券化商品(CTP))	-
8	デフォルト・リスク(非証券化商品)	18,460
9	デフォルト・リスク(証券化商品(非CTP))	11
10	デフォルト・リスク(証券化商品(CTP))	-
11	残余リスク・アドオン	3,995
	その他	-
12	合計	125,192

【MR3】簡易的方式によるマーケット・リスク相当額

(単位 百万円)

		オプション取引 以外の取引	オプション取引		
			簡便法により 算出した額	デルタ・プラス 法により 算出した額	シナリオ法 により算出した額
1	金利リスク(一般市場リスク及び個別リスク)の額	-	-	-	-
2	株式リスク(一般市場リスク及び個別リスク)の額	277	-	-	-
3	コモディティ・リスクの額	-	-	-	-
4	外国為替リスクの額	2	-	-	-
5	証券化エクスポージャーに係る個別リスクの額	-			
6	合計	280	-	-	-

【CVA1】 限定的な BA-CVA

(単位 百万円)

		構成要素の額	BA-CVAによる CVAリスク相当額
1	CVAリスクのうち取引先共通の要素	5,957	
2	CVAリスクのうち取引先固有の要素	1,323	
3	合計		2,074

【CVA3】 SA-CVA の CVA リスク相当額と取引相手方の先数

(単位 百万円、先数)

		CVAリスク相当額	取引相手方の先数
1	金利リスク	675	
2	外国為替リスク	620	
3	参照先のクレジット・スプレッド・リスク	11	
4	株式リスク	34	
5	コモディティ・リスク	-	
6	取引相手方のクレジット・スプレッド・リスク	5,822	
7	合計	7,164	1,255

【CVA4】 CVA リスク・エクスポージャーの CVA リスク相当額の変動表

(単位 百万円)

	前期末:2025年3月末 当期末:2026年3月末	CVAリスク相当額
1	前期末	7,939
2	当期末	9,239
	変動事由の説明	CVAリスク相当額の増加はSA-CVAにおける取引相手方のクレジット・スプレッド・リスクの増加によるもの

【OR1】オペレーショナル・リスク損失の推移

OR1 その1

(単位 百万円,件)

		2026年 3月末	2025年 3月末	2024年 3月末	2023年 3月末
二百万円を超える損失を集計したもの					
1	ネットの損失の合計額(特殊損失控除前)	1,954	2,120	171	467
2	損失の件数	178	28	25	34
3	特殊損失の総額	-	-	-	-
4	特殊損失の件数	-	-	-	-
5	ネットの損失の合計額(特殊損失控除後)	1,954	2,120	171	467
千万円を超える損失を集計したもの					
6	ネットの損失の合計額(特殊損失控除前)	1,376	2,021	91	343
7	損失の件数	50	9	5	9
8	特殊損失の総額	-	-	-	-
9	特殊損失の件数	-	-	-	-
10	ネットの損失の合計額(特殊損失控除後)	1,376	2,021	91	343
オペレーショナル・リスク相当額の計測に関する事項					
11	ILMの算出への内部損失データ利用の有無	有	有	有	有
12	項番11で内部損失データを利用していない場合は、内部損失データの承認基準充足の有無	-	-	-	-

(注)2026年3月末基準において自己資本比率告示第288条第1号の基準を満たさない一部の連結子会社については、ILMに保守的な見積値を用いています。

		2022年 3月末	2021年 3月末	2020年 3月末	2019年 3月末
二百万円を超える損失を集計したもの					
1	ネットの損失の合計額(特殊損失控除前)	195	288	-	-
2	損失の件数	30	37	-	-
3	特殊損失の総額	-	-	-	-
4	特殊損失の件数	-	-	-	-
5	ネットの損失の合計額(特殊損失控除後)	195	288	-	-
千万円を超える損失を集計したもの					
6	ネットの損失の合計額(特殊損失控除前)	92	152	-	-
7	損失の件数	3	5	-	-
8	特殊損失の総額	-	-	-	-
9	特殊損失の件数	-	-	-	-
10	ネットの損失の合計額(特殊損失控除後)	92	152	-	-
オペレーショナル・リスク相当額の計測に関する事項					
11	ILMの算出への内部損失データ利用の有無	有	有	-	-
12	項番11で内部損失データを利用していない場合は、内部損失データの承認基準充足の有無	-	-	-	-

OR1 その2

(単位 百万円,件)

		2018年 3月末	2017年 3月末	直近十年間の平 均
二百万円を超える損失を集計したもの				
1	ネットの損失の合計額(特殊損失控除前)	-	-	866
2	損失の件数	-	-	55
3	特殊損失の総額	-	-	-
4	特殊損失の件数	-	-	-
5	ネットの損失の合計額(特殊損失控除後)	-	-	866
千万円を超える損失を集計したもの				
6	ネットの損失の合計額(特殊損失控除前)	-	-	679
7	損失の件数	-	-	13
8	特殊損失の総額	-	-	-
9	特殊損失の件数	-	-	-
10	ネットの損失の合計額(特殊損失控除後)	-	-	679
オペレーショナル・リスク相当額の計測に関する事項				
11	ILMの算出への内部損失データ利用の有無	-	-	有
12	項番11で内部損失データを利用していない場合は、内部損失データの承認基準充足の有無	-	-	-

【OR2】BIC の構成要素

(単位 百万円)

		2026年3月末	2025年3月末	2024年3月末
1	ILDC	90,013		
2	資産運用収益	1,709	4,319	4,342
3	資金調達費用	▲ 19,510	▲ 19,937	▲ 17,837
4	金利収益資産	6,933,056	5,375,222	4,734,064
5	受取配当金	▲ 688	▲ 1,943	▲ 2,098
6	SC	613,726		
7	役務取引等収益	2,533	3,713	8,962
8	役務取引等費用	1,595,887	1,563,829	1,447,762
9	その他業務収益	36,163	36,598	30,001
10	その他業務費用	496,964	434,738	360,590
11	FC	113,256		
12	トレーディング商品のネット損益(トレーディング業務等のネット損益)	3,610,598	2,793,554	2,722,321
13	トレーディング商品以外のネット損益(トレーディング業務等以外のネット損益)	654	994	791
14	BI	816,995		
15	BIC	117,181		
16	除外特例の対象となる連結子法人又は事業部門を含むBI	816,995		
17	除外特例によって除外したBI	-		

【OR3】オペレーショナル・リスクに対する所要自己資本額の概要

(単位 百万円)

1	BIC	117,181
2	ILM	0.67
3	オペレーショナル・リスク相当額	78,798
4	オペレーショナル・リスク・アセットの額	984,976

【IRRBB1】金利リスク

(単位 百万円)

		△EVE	
		2026年3月末	2025年3月末
1	上方パラレルシフト	10,662	10,586
2	下方パラレルシフト	39,466	32,618
3	スティープ化	6,687	4,711
4	フラット化	3,004	652
5	短期金利上昇	3,406	3,517
6	短期金利低下	11,521	15,470
7	最大値	39,466	32,618
		2026年3月末	2025年3月末
8	Tier1 資本の額	1,618,172	1,540,625

(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・アセットの額の合計額とデフォルト・リスクに対するマーケット・リスク相当額の合計額を8パーセントで除して得た額とを合算した額	カウンター・シクリカル・バッファ比率	カウンター・シクリカル・バッファの額
オーストラリア	1.00%	125,876		
ベルギー	1.00%	11,408		
フランス	1.00%	2,858		
ドイツ	0.75%	10,926		
香港	0.50%	23,543		
韓国	1.00%	79,705		
ルクセンブルク	0.50%	24,510		
オランダ	2.00%	24,507		
スペイン	0.50%	0		
スウェーデン	2.00%	12		
英国	2.00%	109,067		
小計		412,417		
合計		4,655,043	0.11%	9,021

(注)「カウンター・シクリカル・バッファ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

【LR1】 会計上の資産とレバレッジ比率エクスポージャーの比較

(単位 百万円)

項目 (国際様式 (LR1)の 該当番号)	項目	2026年3月末	2025年3月末
1	連結貸借対照表における総資産の額	38,077,646	36,024,346
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(△)	-	-
3	リスク移転の認識に係る要件を充足しない証券化エクスポージャーに係る調整	-	-
4	中央銀行預け金に係る除外による調整(△)	3,007,298	2,941,611
5	顧客資産のうち、連結貸借対照表に計上されている金額(△)	-	-
6	有価証券の売買を約定日基準により会計処理している場合における調整項目	3,131	2,098
7	キャッシュ・フロー契約に基づく資金の移動に係る調整項目	-	-
8	デリバティブ取引等に関する調整額	▲ 1,198,172	▲ 834,999
8a	デリバティブ取引等に関する額	3,282,751	2,027,709
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額(△)	4,480,923	2,862,708
9	レボ取引等に関する調整額	▲ 1,986,814	▲ 3,235,859
9a	レボ取引等に関する額	10,473,926	12,301,780
9b	レボ取引等に関する額(△)	12,460,741	15,537,639
10	オフ・バランス取引に関する額	178,430	224,636
11	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)	-	-
12	その他の調整項目	▲ 361,417	▲ 379,401
12a	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	293,349	258,567
12b	支払承諾見返勘定の額(△)	-	-
12c	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(相殺した額に相当する部分に限る。)	-	-
12d	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(△)	69,888	122,373
12e	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。)	1,819	1,539
13	総エクスポージャーの額	31,705,504	28,859,210

【LR2】レバレッジ比率に関する共通開示テンプレート

LR2 その1

(単位 百万円 %)

項番 (国際様式 (LR2)の 該当番号)	項目	2026年3月末	2025年3月末
オン・バランス資産の額 (1)			
1	個別項目調整前のオン・バランス資産の額	18,133,634	14,686,024
2	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(相殺した額に相当する部分に限る。)	-	-
3	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(△)	69,888	122,373
4	レポ取引等により受領した証券の計上額(△)	-	-
5	Tier1 資本に係る調整項目の額(貸倒引当金)(△)	-	-
6	Tier1 資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	293,349	258,567
7	オン・バランス資産の額 (イ)	17,770,396	14,305,083
デリバティブ取引等に関する額 (2)			
8	デリバティブ取引等に関するRC の額に1.4 を乗じた額	930,830	653,049
9	デリバティブ取引等に関するPFE の額に1.4 を乗じた額	1,368,096	474,127
10	間接清算参加者に適格中央清算機関の債務履行を保証していない場合に零とした中央清算機関向けエクスポージャーの額(△)		
11	クレジット・デリバティブ等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	4,579,531	3,852,960
12	クレジット・デリバティブ等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(△)	3,595,707	2,952,428
13	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	3,282,751	2,027,709
レポ取引等に関する額 (3)			
14	レポ取引等に関する資産の額	14,063,580	16,940,445
15	レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	3,973,627	4,999,723
16	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	383,973	361,058
17	代理取引のエクスポージャーの額		
18	レポ取引等に関する額 (ハ)	10,473,926	12,301,780
オフ・バランス取引に関する額 (4)			
19	オフ・バランス取引の想定元本の額	570,085	672,350
20	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(△)	391,654	447,714
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	178,430	224,636
連結レバレッジ比率 (5)			
23	資本の額 (ホ)	1,618,172	1,540,625
24	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	31,705,504	28,859,210
25	連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	5.10%	5.33%
26	適用する所要連結レバレッジ比率	3.15%	3.15%
27	適用する所要連結レバレッジ・バッファー比率	-	-

LR2 その2

(単位 百万円 %)

項番 (国際様式 (LR2)の 該当番号)	項目	2026年3月末	2025年3月末
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)	31,705,504	28,859,210
	日本銀行に対する預け金の額	3,007,298	2,941,611
	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')	34,712,803	31,800,822
	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'))	4.66%	4.84%
平均値の開示 (7)			
28	レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値((ト)+(チ))	11,439,051	11,756,808
	レボ取引等に関する資産の額に係る平均値 (ト)	14,127,670	15,096,236
	レボ取引等に関する資産の額から控除した額に係る平均値(△) (チ)	2,688,619	3,339,428
29	レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る四半期末の値((リ)+(ヌ))	10,089,952	11,940,722
14	レボ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値 (リ)	14,063,580	16,940,445
15	レボ取引等に関する資産の額から控除した額に係る四半期末の値 (ヌ)	3,973,627	4,999,723
30	総エクスポージャーの額(レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合) (ル)	33,054,603	28,675,296
30a	総エクスポージャーの額(レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合) (ヲ)	36,061,901	31,616,908
31	連結レバレッジ比率(レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入しない場合)((ホ)/(ル))	4.89%	5.37%
31a	連結レバレッジ比率(レボ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値を使用し、日本銀行に対する預け金を算入する場合)((ホ)/(ヲ))	4.48%	4.87%

2. 前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	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	1,437,120 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	17 百万円	27 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2006年7月1日	2007年7月1日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性的手段(23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部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	32 百万円	74 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	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	111 百万円	215 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	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	294 百万円	242 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	285 百万円	305 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	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	344 百万円	150 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2017年2月8日	2017年2月8日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性的手段(23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部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	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	394 百万円	281 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2018年2月8日	2018年2月8日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段(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	208 百万円	125 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2018年8月10日	2019年8月15日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段(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17回新株予約権	第18回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	228 百万円	459 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2020年8月17日	2021年8月13日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段(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19回新株予約権	第20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	204 百万円	571 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)	2022年8月15日	2023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21回新株予約権	第22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	850 百万円	396 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)	2024年8月16日	2025年8月14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	大和アセットマネジメント	大和証券オフィス投資法人
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 3,337百万円 Tier2資本に係る基礎項目の額 785百万円	その他Tier1 資本に係る基礎項目の額 29,555百万円 Tier2資本に係る基礎項目の額 6,954百万円
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	—
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 9,869百万円 Tier2資本に係る基礎項目の額 2,322百万円
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	—
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	JP350220BL39	JP350220BQC4
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	令和4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	令和4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)	第3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	24,900 百万円	111,300 百万円
9	額面総額 (5)	25,000 百万円	115,000 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	2024年12月5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)	2030年6月5日:元本全額償還	2029年12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	2024年12月5日の翌日から2029年12月5日まで: 年2.199パーセント 2029年12月5日の翌日以降: 5年国債金利+1.480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)	—	—

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	JP350220AQC6
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	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	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
7	銘柄、名称又は種類	第4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	10,000 百万円
9	額面総額 (5)	10,000 百万円
10	表示される科目の区分 (6)	
	連結貸借対照表	負債
11	発行日 (7)	2024年12月5日
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	有
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	2034年12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
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
	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)	固定から変動
18	配当率又は利率 (12)	2024年12月5日の翌日から2034年12月5日まで: 年2.642パーセント 2034年12月5日の翌日以降: 5年国債金利+1.580パーセント
19	配当等停止条項の有無 (13)	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
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)	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
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	全部削減又は一部削減
33	元本回復特約の有無 (22)	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
34a	劣後性の手段(23)	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、最も劣後の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)	—

以 上