

2026年1月30日

各 位

会社名 株式会社大和証券グループ本社

代表者名 代表執行役社長 荻野 明彦

(コード番号 8601 東証プライム・名証プレミア)

連結自己資本規制比率及び連結レバレッジ比率に関するお知らせ

— 経営の健全性の状況 (2025年9月末) —

金融商品取引法第57条の17の規定に基づく大和証券グループ本社の経営の健全性の状況  
(2025年9月末)について下記のとおりお知らせいたします。

記

## 目次

■ 主要な指標.....	3
■ 自己資本の構成に関する開示事項.....	4
■ 定性的な開示事項.....	7
1. 連結の範囲に関する事項.....	7
2. 連結貸借対照表の科目と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係.....	9
■ 定量的な開示事項.....	11
1. その他金融機関等であって最終指定親会社の子法人等であるもののうち、連結自己資本規制比率規制上の所要自己資本を下回った会社の名称及び所要自己資本を下回った額の総額.....	11
2. リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーについて、エクスポージャーの区分ごとの額.....	11
3. その他定量的な開示事項.....	12
■ 連結レバレッジ比率に関する開示事項.....	38
1. 連結レバレッジ比率の構成に関する開示.....	38
■ 自己資本調達手段に関する契約内容の概要.....	41

## ■ 主要な指標

### 【KM1】 主要な指標

国際様式 の 該当番号		(単位 百万円、%)				
		2025年 9月末	2025年 6月末	2025年 3月末	2024年 12月末	2024年 9月末
<b>資本</b>						
1	普通株式等Tier1資本の額	1,356,407	1,355,894	1,351,434	1,413,899	1,274,461
2	Tier1資本の額	1,542,917	1,544,076	1,540,625	1,605,012	1,462,684
3	総自己資本の額	1,547,863	1,550,812	1,547,823	1,615,274	1,470,667
<b>リスク・アセット</b>						
4	リスク・アセットの額	7,381,082	7,104,033	7,086,475	7,509,731	7,189,880
4a	リスク・アセットの額 (フロア調整前)	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)	7,381,082	7,104,033	7,086,475		
<b>自己資本比率</b>						
5	連結普通株式等Tier1比率	18.37%	19.08%	19.07%	18.82%	17.72%
5a	連結普通株式等Tier1比率 (フロア調整前)	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)	18.37%	19.08%	19.07%		
6	連結Tier1比率	20.90%	21.73%	21.74%	21.37%	20.34%
6a	連結Tier1比率 (フロア調整前)	20.90%	21.73%	21.74%		
	連結Tier1比率 (フロア調整最終実施ベース)	20.90%	21.73%	21.74%		
7	連結総自己資本比率	20.97%	21.83%	21.84%	21.50%	20.45%
7a	連結総自己資本比率 (フロア調整前)	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)	20.97%	21.83%	21.84%		
<b>資本バッファー</b>						
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	0.10%	0.10%	0.10%	0.12%	0.11%
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	3.10%	3.10%	3.10%	3.12%	3.11%
12	連結資本バッファー比率	12.97%	13.83%	13.84%	13.50%	12.45%
<b>連結レバレッジ比率</b>						
13	総エクスポートジャーヤーの額	29,273,935	28,286,364	28,859,210	29,240,454	26,665,976
14	連結レバレッジ比率	5.27%	5.45%	5.33%	5.48%	5.48%

## ■自己資本の構成に関する開示事項

### 【CC1】自己資本の構成

(単位：百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目	当最終指定親会 社四半期末	別紙様式第八号 (CC2)の参照項 目
普通株式等Tier1資本に係る基礎項目		(1)	
1a+2-1c-26	普通株式に係る株主資本の額	1,410,634	
1a	うち、資本金及び資本剰余金の額	514,530	(i), (j)
2	うち、利益剰余金の額	1,080,713	(k)
1c	うち、自己株式の額(△)	144,359	(l), (m)
26	うち、社外流出予定額(△)	40,249	
	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	5,966	(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	216,994	(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)	1,633,595
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・ライツに係るものと除く。)の額の合計額	191,427	
8	うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	60,920	(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	130,507	(f)
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	345	(d), (h)
11	繰延ヘッジ損益の額	▲ 1,390	(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	755	
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	137	(b)
17	意図的に保有している他の金融機関等の普通株式の額	–	
18	少数出資金融機関等の普通株式の額	15,096	(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	70,815	
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	70,815	
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)	277,187
普通株式等Tier1資本			
29	普通株式等Tier1資本の額 ((イ) - (ロ))	(ハ)	1,356,407

(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	148,100	
	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	42,561	(q)
36	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 (二)	190,661	
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	2,349	(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	1,801	
42	Tier2資本不足額	–	
43	その他Tier1資本に係る調整項目の額 (ホ)	4,151	
その他Tier1資本			
44	その他Tier1資本の額 ((二) – (ホ)) (ヘ)	186,510	
Tier1資本			
45	Tier1資本の額 ((ハ) + (ヘ)) (ト)	1,542,917	
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	10,014	(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)	10,014	

(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	5,069	(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・マイク目的保有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)	5,069	
Tier2資本			
58	Tier2資本の額 ((チ)–(リ)) (ヌ)	4,945	
総自己資本			
59	総自己資本の額 ((ト)+(ヌ)) (ル)	1,547,863	
リスク・アセット			
60	リスク・アセットの額の合計額 (ヲ)	7,381,082	
連結自己資本規制比率			
61	連結普通株式等Tier1比率 ((ハ)/(ヲ))	18.37%	
62	連結Tier1比率 ((ト)/(ヲ))	20.90%	
63	連結総自己資本規制比率 ((ル)/(ヲ))	20.97%	
64	最低連結資本バッファー比率	3.10%	
65	うち、資本保全バッファー比率	2.50%	
66	うち、カウンター・シクリカル・バッファー比率	0.10%	
67	うち、G-SIB/D-SIB バッファー比率	0.50%	
68	連結資本バッファー比率	12.97%	
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	144,231	(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	142,722	(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	6,987	(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	125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。

二)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	689	434
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	261	240
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	530	479
Daiwa Corporate Investment Asia Ltd.	投資業	243	227
アイ・エル・シー株式会社	投資運用業、投資助言・代理業	468	▲ 902
Rimor Fund I GP Limited	投資運用業	110	96
Rimor Fund II GP Limited	投資運用業	40	34

会社グループに属しない会社であって会計連結範囲に含まれるものについては、該当ありません。

ホ)会社グループ内の資金及び自己資本の移動に係る制限等の概要

グループ内の資金及び自己資本の移動に係る特別な制限等はありません。

## 2. 連結貸借対照表の科目と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係

### 【CC2】連結貸借対照表の科目と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係

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	(単位 百万円) 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	4,535,214	4,536,814	
預託金	648,937	648,937	
受取手形、売掛金及び契約資産	34,306	34,306	
有価証券 (a)	1,899,699	1,899,699	8, 18, 39, 54, 72, 73
トレーディング商品 (b)	10,432,473	10,432,473	16, 18, 39, 54, 72, 73
約定見返勘定	-	-	
営業投資有価証券 (c)	108,703	108,703	18, 39, 54, 72, 73
投資損失引当金	▲ 566	▲ 566	
営業貸付金	2,412,083	2,412,083	
仕掛品	1,361	1,361	
信用取引資産	164,720	164,720	
有価証券担保貸付金	13,910,455	13,910,455	
立替金	48,858	48,858	
短期貸付金	707	707	
未収収益	112,109	112,234	
繰延税金資産 (d)	-	-	10, 75
その他の流動資産	837,477	837,900	
貸倒引当金	▲ 14,637	▲ 14,637	
流動資産計	35,131,907	35,134,055	
固定資産			
有形固定資産	938,430	938,436	
無形固定資産	145,793	145,827	
のれん (e)	15,971	15,971	8
のれん以外 (f)	129,821	129,855	9
投資その他の資産	699,169	698,768	
投資有価証券 (g)	645,060	644,615	8, 18, 39, 54, 72, 73
繰延税金資産 (h)	7,327	7,332	10, 75
上記以外	46,781	46,821	
固定資産計	1,783,392	1,783,033	
繰延資産計	-	-	
資産の部合計	36,915,300	36,917,088	

(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	9,668	9,668	
トレーディング商品	6,886,473	6,886,473	
約定見返勘定	1,128,393	1,128,393	
信用取引負債	44,156	44,156	
有価証券担保借入金	15,226,921	15,226,921	
銀行業における預金	4,780,929	4,780,929	
預り金	834,350	834,362	
受入保証金	418,198	418,198	
短期借入金	1,579,516	1,580,816	
コマーシャルペーパー	349,000	349,000	
1年内償還予定の社債	370,067	370,067	
未払法人税等	32,862	32,909	
繰延税金負債	-	-	
賞与引当金	31,719	31,719	
その他の流動負債	161,917	162,157	
固定負債			
社債	1,143,898	1,143,898	
長期借入金	1,814,092	1,814,092	
繰延税金負債	56,441	56,441	
退職給付に係る負債	43,738	43,738	
訴訟損失引当金	357	357	
負ののれん	-	-	
その他の固定負債	51,880	52,019	
特別法上の準備金	6,281	6,281	
負債の部合計	34,970,866	34,972,603	
純資産の部			
株主資本			
資本金 (i)	247,397	247,397	1a
資本剰余金 (j)	267,132	267,132	1a
利益剰余金 (k)	1,080,835	1,080,714	2
自己株式 (l)	▲ 144,458	▲ 144,458	1c
自己株式申込証拠金 (m)	99	99	1c
株主資本合計	1,451,005	1,450,884	
その他の包括利益累計額			
その他有価証券評価差額金	73,310	73,310	
繰延ヘッジ損益 (n)	13,869	13,869	11
為替換算調整勘定	129,870	129,870	
退職給付に係る調整累計額	▲ 56	▲ 56	
その他の包括利益累計額 (o)	216,994	216,994	3
新株予約権 (p)	5,966	5,966	1b
非支配株主持分 (q)	270,467	270,639	34-35, 48-49
純資産の部合計	1,944,434	1,944,484	

## ■ 定量的な開示事項

1. その他金融機関等であって最終指定親会社の子法人等であるもののうち、連結自己資本規制比率規制上の所要自己資本を下回った会社の名称及び所要自己資本を下回った額の総額

該当ありません。

2. リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーについて、エクスポージャーの区分ごとの額

(単位 百万円)	
	エクspoージャーの額
リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(ルック・スル一方式)	595,988
リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(マンデート方式)	11,686
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%)	145
合計	607,821

### 3. その他定量的な開示事項

#### 【OV1】リスク・アセットの概要

(単位 百万円)

国際様式 の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2025年 9月末	2024年 9月末	2025年 9月末	2024年 9月末
1	信用リスク	2,824,868	-	225,989	-
2	うち、標準的手法適用分	1,622,046	-	129,763	-
3	うち、基礎的内部格付手法適用分	-	-	-	-
4	うち、スロッティング・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トジャー	-	-	-	-
	うち、リース取引における見積残存価額のエクスポートジャー	-	-	-	-
	その他	1,202,821	-	96,225	-
6	カウンターパーティ信用リスク	1,027,486	-	82,198	-
7	うち、SA-CCR適用分	291,298	-	23,303	-
8	うち、期待エクスポートジャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、中央清算機関関連エクスポートジャー	29,017	-	2,321	-
9	その他	707,170	-	56,573	-
10	CVAリスク	103,827	-	8,306	-
	うち、SA-CVA適用分	79,300	-	6,344	-
	うち、完全なBA-CVA適用分	-	-	-	-
	うち、限定的なBA-CVA適用分	24,526	-	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 エクスポートジャー	-	-	-	-
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 (ブラック・スルーア方式)	432,491	-	34,599	-
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 (マンデート方式)	24,856	-	1,988	-
	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%)	1,817	-	145	-
15	未決済取引	13,270	-	1,061	-
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ト ジャー	243,793	-	19,503	-
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	206,253	-	16,500	-
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	37,540	-	3,003	-
20	マーケット・リスク	1,404,890	-	112,391	-
21	うち、標準的方式適用分	1,401,307	-	112,104	-
22	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
	うち、簡易的方式適用分	3,582	-	286	-
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーション・リスク	929,506	-	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ト ジャー	374,273	-	29,941	-
26	プロア調整	-	-	-	-
27	合計	7,381,082	-	590,486	-

(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	
		2025年 9月末	2025年 6月末	2025年 9月末	2025年 6月末
1	信用リスク	2,824,868	2,731,103	225,989	218,488
2		うち、標準的手法適用分	1,622,046	1,520,900	129,763
3		うち、基礎的内部格付手法適用分	-	-	-
4		うち、スロッティング・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ト	-	-	-
		うち、リース取引における見積残存価額のエクスポート	-	-	-
	その他	1,202,821	1,210,203	96,225	96,816
6	カウンターパーティ信用リスク	1,027,486	974,629	82,198	77,970
7		うち、SA-CCR適用分	291,298	314,865	23,303
8		うち、期待エクスポート方式適用分	-	-	-
		うち、中央清算機関連エクスポート	29,017	21,121	2,321
9		その他	707,170	638,643	56,573
10	CVAリスク	103,827	104,913	8,306	8,393
		うち、SA-CVA適用分	79,300	81,872	6,344
		うち、完全なBA-CVA適用分	-	-	-
		うち、限定的なBA-CVA適用分	24,526	23,040	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 エクスポート	-	-	-	-
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 (ルック・スルー方式)	432,491	410,599	34,599	32,847
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 (マンデート方式)	24,856	16,687	1,988	1,335
	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%)	1,817	1,695	145	135
15	未決済取引	13,270	886	1,061	70
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ト	243,793	227,485	19,503	18,198
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	206,253	190,842	16,500
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	37,540	36,642	3,003	2,931
20	マーケット・リスク	1,404,890	1,399,353	112,391	111,948
21		うち、標準的方式適用分	1,401,307	1,396,108	112,104
22		うち、内部モデル方式適用分	-	-	-
		うち、簡易的方式適用分	3,582	3,244	286
23	勘定間の振替分	-	-	-	-
24	オペレーション・リスク	929,506	863,720	74,360	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ト	374,273	372,960	29,941	29,836
26	プロア調整	-	-	-	-
27	合計	7,381,082	7,104,033	590,486	568,322

【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 エクスポート ジャーの額
1	現金・預金	2,218	4,534,595	4,536,814	-
2	預託金	-	648,937	648,937	-
3	受取手形及び売掛金	-	34,306	34,306	-
4	有価証券	383,505	1,516,193	1,899,699	134,344
5	トレーディング商品	469,805	9,962,668	10,432,473	-
6	約定見返勘定	-	-	-	-
7	営業投資有価証券	-	108,703	108,703	-
8	投資損失引当金	-	▲ 566	▲ 566	-
9	営業貸付金	654,225	1,757,858	2,412,083	890,877
10	仕掛品	-	1,361	1,361	-
11	信用取引資産	-	164,720	164,720	-
12	有価証券担保貸付金	-	13,910,455	13,910,455	-
13	立替金	-	48,858	48,858	-
14	短期貸付金	-	707	707	-
15	未収収益	-	112,234	112,234	-
16	繰延税金資産	-	-	-	-
17	その他の流動資産	36,832	801,067	837,900	-
18	貸倒引当金	-	▲ 14,637	▲ 14,637	-
19	有形固定資産	-	938,436	938,436	-
20	無形固定資産	-	145,827	145,827	-
21	のれん	-	15,971	15,971	-
22	のれん以外	-	129,855	129,855	-
23	投資その他の資産	20,095	678,673	698,768	-
24	投資有価証券	20,095	624,519	644,615	-
25	繰延税金資産	-	7,332	7,332	-
26	上記以外	-	46,821	46,821	-
	合計	1,566,682	35,350,406	36,917,088	1,025,221

### 【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 ジヤー	非 デフォルト エクスポー ジヤー		
オン・バランスシートの資産					
1 貸出金		37,332	1,474,711	14,150	1,497,893
2 有価証券 (うち負債性のもの)		-	1,672,106	-	1,672,106
3 その他オン・バランスシートの資産 (うち負債性のもの)		26,512	4,750,483	1,200	4,775,795
4 オン・バランスシートの資産の合計 (1+2+3)		63,844	7,897,301	15,350	7,945,796
オフ・バランスシートの資産					
5 支払承諾等		-	80,074	-	80,074
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)		-	80,074	-	80,074
合計					
8 合計(4+7)		63,844	7,977,376	15,350	8,025,870

(注)「ネット金額」の項目では、「デフォルトしたエクスポート」と「非デフォルトエクスポート」の合計額から「引当金」を差し引いた値を記載しております。

〔CR2〕デフォルトした貸出金・有価証券等（うち負債性のもの）の残高の変動

(単位 百万円)

前事業年度末:2025年3月末 当中間期末:2025年9月末		額
1	前事業年度末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の残高	64,766
2		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	当中間期末時点においてデフォルト状態にある貸出金・有価証券等(うち負債性のもの)の残高 (1+2-3-4+5)	63,844

(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ト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

(单位 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 ープで保全 された エクスポー ジャー
1	貸出金	891,434	606,459	358,744	247,714	-
2	有価証券(負債性のもの)	1,518,837	153,268	-	153,268	-
3	その他オン・バランスシートの資産(負債性のもの)	4,774,333	1,462	7	1,454	-
4	合計(1+2+3)	7,184,605	761,190	358,752	402,437	-
5	うちデフォルトしたもの	54,465	-	-	-	-

【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spoージャー		CCF・信用リスク削減手法適用後のエクspoージャー		信用リスク・アセットの額	リスク・ウェイトの加重平均値(RWA density)
		オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額	オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額		
1a	日本国政府及び日本銀行向け	4,643,140	-	4,643,140	-	-	-
1b	外国の中央政府及び中央銀行向け	422,464	-	422,464	-	2,070	0.49%
1c	国際決済銀行等向け	71	-	71	-	-	-
2a	我が国の地方公共団体向け	123,685	-	123,685	-	-	-
2b	外国の中央政府等以外の公共部門向け	34,529	-	34,529	-	6,457	18.70%
2c	地方公共団体金融機構向け	25,906	-	25,906	-	4,254	16.42%
2d	我が国の政府関係機関向け	561,335	-	561,335	-	31,316	5.58%
2e	地方三公社向け	0	-	0	-	0	20.00%
3	国際開発銀行向け	39,403	-	39,403	-	2,678	6.80%
4	金融機関、第一種金融商品取引業者及び保険会社向け	1,229,054	14,539	1,229,054	14,539	317,701	25.55%
	うち、第一種金融商品取引業者及び保険会社向け	32,439	-	32,439	-	12,318	37.97%
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。)	751,368	19,976	655,513	16,487	457,854	68.13%
	うち、特定貸付債権向け	14,936	1,143	14,936	457	18,335	119.11%
7a	劣後債権及びその他資本性証券等	-	-	-	-	-	-
7b	株式等	364,304	39,996	364,304	17,886	497,363	130.13%
8	中堅中小企業等向け及び個人向け	373,356	588,938	110,458	31,341	156,868	110.63%
	うち、トランザクター向け	-	-	-	-	-	-
9	不動産関連向け	60,075	4,077	60,075	1,631	66,583	107.90%
	うち、自己居住用不動産等向け	-	-	-	-	-	-
	うち、賃貸用不動産向け	36,773	-	36,773	-	29,382	79.90%
	うち、事業用不動産関連	476	-	476	-	514	108.06%
	うち、その他不動産関連	-	-	-	-	-	-
	うち、ADC向け	22,826	4,077	22,826	1,631	36,686	150.00%
10a	延滞等(自己居住用不動産等向けエクspoージャーを除く。)	54,465	-	54,465	-	78,896	144.86%
10b	自己居住用不動産等向けエクspoージャーに係る延滞	-	-	-	-	-	-
11a	現金	4	-	4	-	-	-
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	8,683,167	667,529	8,324,414	81,887	1,622,046	19.30%

【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spo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	4,643,140	-	-	-	-
1b	外国の中央政府及び中央銀行向け	402,660	10	1	95	1
1c	国際決済銀行等向け	71	-	-	-	-
		0%	10%	20%	50%	100%
2a	我が国の地方公共団体向け	123,685	-	-	-	-
2b	外国の中央政府等以外の公共部門 向け	-	4,480	30,048	-	-
2c	地方公共団体金融機構向け	-	9,265	16,640	-	-
2d	我が国の政府関係機関向け	254,192	301,126	6,017	-	-
2e	地方三公社向け	-	-	0	-	-
		0%	20%	30%	50%	100%
3	国際開発銀行向け	26,012	13,391	-	-	-
		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	759,027	442,565	4,488	10,273	-
	うち、第一種金融商品取引業者及 び保険会社向け	14,716	10,222	2,892	590	-
		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。)	9,673	201,277	78,639	-	-
	うち、特定貸付債権向け	-	-	-	-	-
		100%	125%	150%	130%	160%
7a	劣後債権及びその他資本性証券等	-	-	-	-	-
7b	株式等	-	-	-	380,475	1,715
		45%	75%	100%	その他	合計
8	中堅中小企業等向け及び個人向け	-	-	111,665	30,135	141,800

CR5a その2

(単位 百万円)

	リスク・ウェイト	信用リスク・エクスポートの額 (CCF・信用リスク削減手法適用後)			
		その他	合計		
	資産クラス				
1a	日本国政府及び日本銀行向け	-	4,643,140		
1b	外国の中央政府及び中央銀行向け	19,693	422,464		
1c	国際決済銀行等向け	-	71		
		150%	その他	合計	
2a	我が国の地方公共団体向け	-	-	123,685	
2b	外国の中央政府等以外の公共部門 向け	-	-	34,529	
2c	地方公共団体金融機構向け	-	-	25,906	
2d	我が国の政府関係機関向け	-	-	561,335	
2e	地方三公社向け	-	-	0	
		150%	その他	合計	
3	国際開発銀行向け	-	-	39,403	
		100%	150%	その他	合計
4	金融機関、第一種金融商品取引業者 及び保険会社向け	1,900	15,567	9,771	1,243,593
	うち、第一種金融商品取引業者及 び保険会社向け	1,299	2,371	347	32,439
		50%	100%	その他	合計
5	カバード・ボンド向け	-	-	-	-
		100%	130%	150%	その他
6	法人等向け(特定貸付債権向けを含 む。)	283,543	9,805	7	89,054 672,001
	うち、特定貸付債権向け	5,588	9,805	-	15,393
		その他	合計		
7a	劣後債権及びその他資本性証券等	-	-		
7b	株式等	-	382,191		
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・エクスポートナーの額 (CCF・信用リスク削減手法適用後)				
		20%	25%	30%	40%	50%
9a	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	20%	31.25%	37.5%	50%	62.5%
9b	不動産関連向け うち、賃貸用不動産向け	329	231	1,914	3,301	20,616
	うち、抵当権が第二順位以下で適格要件をみたすもの	30%	43.75%	56.25%	75%	93.75%
9c	不動産関連向け うち、事業用不動産関連	-	46	430	-	-
	うち、抵当権が第二順位以下で適格要件をみたすもの	70%	112.5%	-	-	その他
9d	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	不動産関連向け うち、ADC向け	-	24,457	-	24,457	-
		100%	150%	その他	合計	-
10a	延滞等(自己居住用不動産等向けエクスポートナーを除く。)	2,801	-	51,663	0	54,465
	自己居住用不動産等向けエクスポートナーに係る延滞	-	-	-	-	-
11a	現金	4	-	-	-	4
	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	信用リスク・エクスポートナーの額 (CCF・信用リスク削減手法適用後)				
		70%	75%	その他	合計	
	資産クラス					
9a	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			その他	合計	
9b	不動産関連向け うち、賃貸用不動産向け	105%	150%	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	10,378	-	0	36,773	
9c	不動産関連向け うち、事業用不動産関連	476				
	うち、抵当権が第二順位以下で適格要件をみたすもの	-				
9d	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	不動産関連向け うち、ADC向け					
10a	延滞等(自己居住用不動産等向けエクスポートナーを除く。)					
10b	自己居住用不動産等向けエクスポートナーに係る延滞					
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・エクスポートージャーと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トージャーの額	オフ・バランスシートのエクスポートージャーの額	CCFの加重平均値	信用リスク・エクスポートージャーの額(CCF・信用リスク削減手法適用後)
1	40%未満	7,016,181	14,539	100.00%	7,161,096
2	40%－70%	206,189	－	－	224,059
3	75%	99,255	－	－	99,255
	80%	－	－	－	－
4	85%	－	－	－	－
5	90%－100%	774,470	230,461	16.14%	397,250
6	105%－130%	20,156	1,143	40.00%	20,613
7	150%	202,609	381,388	10.32%	121,834
8	130%	362,589	39,996	44.72%	380,475
9	160%	1,715	－	－	1,715
10	1250%	－	－	－	－
11	合計	8,683,167	667,529	16.39%	8,406,301

【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 ジヤーの 算定に使 用される $\alpha$	信用リスク 削減手法 適用後の エクスポー ジヤー	リスク・ア セットの額
1	SA-CCR	145,716	228,030		1.4	523,245	291,298
2	期待エクスポージャー方式			-	-	-	-
3	信用リスク削減手法における簡便 手法					-	-
4	信用リスク削減手法における包括 的手法					1,616,111	707,170
5	エクスポージャー変動推計モデル					-	-
6	合計						998,469

【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posure

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	497,378	-	-	-	-	-
2 外国の中央政府及び中央銀行向け	5,731	-	1,855	-	-	-
3 国際決済銀行等向け	124,930	-	-	-	-	-
4 我が国の地方公共団体向け	1,139	-	-	-	-	-
5 外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	-	132,873	-	-	-
6 國際開発銀行向け	4,287	-	3,909	-	-	-
7 地方公共団体金融機構向け	-	-	2,409	-	-	-
8 我が国の政府関係機関向け	-	20,351	16,610	-	-	-
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	-	-	82,110	363,032	38,166	
11 法人等向け	-	-	4,868	-	-	-
12 中小企業等向け及び個人向け	-	-	-	-	-	-
13 上記以外	-	-	-	-	-	-
14 合計	633,468	20,351	244,637	363,032	38,166	

  

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	82	-	-	-	-	13
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	1,521	-	-	-	-	-
6 國際開発銀行向け	-	-	-	-	-	-
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	42,425	-	-	-	-	4,999
11 法人等向け	5,745	9,484	-	-	-	747,375
12 中小企業等向け及び個人向け	-	-	-	-	-	-
13 上記以外	-	-	-	-	-	6,275
14 合計	49,774	9,484	-	-	-	758,663

## 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	-	-	-	-	497,378
2 外国の中央政府及び中央銀行向け	-	-	-	-	7,682
3 国際決済銀行等向け	-	-	-	-	124,930
4 我が国の地方公共団体向け	-	-	-	-	1,139
5 外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	-	-	-	134,394
6 国際開発銀行向け	-	-	-	-	8,197
7 地方公共団体金融機構向け	-	-	-	-	2,409
8 我が国の政府関係機関向け	-	-	-	-	36,962
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	-	19,837	-	-	550,571
11 法人等向け	-	1,939	-	-	769,414
12 中小企業等向け及び個人向け	-	-	-	-	-
13 上記以外	-	-	-	-	6,275
14 合計	-	21,777	-	-	2,139,356

## 【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)	20,278	185,138	44,055	334,959	7,749,152	7,543,715	
2 現金(その他通貨)	1,523	65,053	10,836	4,774	9,732,711	7,915,729	
3 国内ソブリン債	10,265	340,305	18,093	70	7,008,616	7,139,699	
4 その他ソブリン債	17,620	3,030	-	-	6,135,235	6,757,171	
5 政府関係機関債	1,129	125,359	-	-	1,039,743	3,249,779	
6 社債	94,743	208,827	-	-	80,639	342,780	
7 株式	71,754	-	-	24,750	685,009	572,339	
8 その他担保	1,866	-	-	-	9,342	859,528	
9 合計	219,182	927,714	72,985	364,554	32,440,451	34,380,743	

(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トージャー

(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	671,227	951,694
2	インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ	3,355,463	3,176,073
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	4,026,691	4,127,767
	公正価値		
7	プラスの公正価値(資産)	3,351	71,448
8	マイナスの公正価値(負債)	▲ 70,652	▲ 5,040

【CCR8】中央清算機関向けエクスポートージャー

(単位 百万円)

		中央清算機関向 け エクスポートージャー (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トージャー(合計)		29,017
2	適格中央清算機関に対するトレード・エクスポートージャー(当初証拠金を除く。)	759,927	15,147
3	(i) 派生商品取引(上場以外)	262,806	5,274
4	(ii) 派生商品取引(上場)	43,014	860
5	(iii) レポ形式の取引	454,106	9,012
6	(iv) クロスプロダクト・ネットティングが承認された場合のネットティング・セット	-	-
7	分別管理されている当初証拠金	22,459	
8	分別管理されていない当初証拠金	38,817	776
9	事前拠出された清算基金	25,984	13,093
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トージャー(合計)		-
12	非適格中央清算機関に対するトレード・エクスポートージャー(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・ネットティングが承認された場合のネットティング・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トナー（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トナーに限る。）

(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トナー	-	-	-
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トナー	-	-	-
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)	448,354	-	448,354
2	担保付住宅ローン	178,104	-	178,104
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トナー	270,249	-	270,249
5	再証券化	-	-	-
6	ホールセール(合計)	594,450	-	594,450
7	事業法人向けローン	579,709	-	579,709
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	14,741	-	14,741
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ト（マーケット・リスク相当額の算出対象となつてある証券化エクスポートに限る。）

(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)	458	-	458
2	担保付住宅ローン	458	-	458
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ト	-	-	-
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ト	-	-	-
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ト	-	-	-
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ト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	
エクスポートジャーの額(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トジャー	1,039,801	1,039,801	1,039,801	445,351	594,450				
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トジャー	-	-	-	-	-				
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トジャー	-	-	-	-	-				
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トジャー	-	-	-	-	-				
5	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポートジャー	3,003	3,003	3,003	3,003	-				
エクスポートジャーの額(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トジャー	-	-	-	-	-				
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トジャー	1,039,801	1,039,801	1,039,801	445,351	594,450				
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポートジャー	-	-	-	-	-				
9	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポートジャー	3,003	3,003	3,003	3,003	-				
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	206,253	206,253	206,253	87,616	118,636				
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トジャーに係る信用リスク・アセット	37,540	37,540	37,540	37,540	-				
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ト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トジャーに係る所要自己資本	16,500	16,500	16,500	7,009	9,490				
16	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポート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トジャーに係る所要自己資本	3,003	3,003	3,003	3,003	-				

			合計					
			資産譲渡型証券化取引(小計)			合成型 証券化取引 (小計)		
			再証券化		シニア	非シニア		
エクスポート・ジャーナーの額(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ト・ジャーナー		-	-	-	-	-	-
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ト・ジャーナー		-	-	-	-	-	-
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ト・ジャーナー		-	-	-	-	-	-
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ト・ジャーナー		-	-	-	-	-	-
5	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポート・ジャーナー		-	-	-	-	-	-
エクスポート・ジャーナーの額(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ト・ジャーナー		-	-	-	-	-	-
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ト・ジャーナー		-	-	-	-	-	-
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポート・ジャーナー		-	-	-	-	-	-
9	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポート・ジャーナー		-	-	-	-	-	-
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ト・ジャーナ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ト・ジャーナ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ト・ジャーナ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ト・ジャーナ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ト・ジャーナーに係る所要自己資本		-	-	-	-	-	-

		合計					
		合成型証券化取引(小計)					
		証券化		再証券化			
		裏付けとなる リテール	ホールセール	シニア		非シニア	
エクスポートジャーナーの額(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トジャーナー	-	-	-	-	-	-
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トジャーナー	-	-	-	-	-	-
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トジャーナー	-	-	-	-	-	-
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トジャーナー	-	-	-	-	-	-
5	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポートジャーナー	-	-	-	-	-	-
エクスポートジャーナーの額(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トジャーナー	-	-	-	-	-	-
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トジャーナー	-	-	-	-	-	-
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポートジャーナー	-	-	-	-	-	-
9	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポートジャーナー	-	-	-	-	-	-
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トジャーナ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トジャーナ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トジャーナ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トジャーナ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トジャーナ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	12,075
2	株式リスク	9,322
3	コモディティ・リスク	196
4	外国為替リスク	26,607
5	信用スプレッド・リスク(非証券化商品)	42,554
6	信用スプレッド・リスク(証券化商品(非CTP))	74
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)	16,917
9	デフォルト・リスク(証券化商品(非CTP))	12
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	4,344
	その他	-
12	合計	112,104

【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	283	-	-	-
3	コモディティ・リスクの額	-	-	-	-
4	外国為替リスクの額	3	-	-	-
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	286	-	-	-

【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	5,477	
2	CVAリスクのうち取引先固有の要素	1,466	
3	合計		1,962

【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	454	
2	外国為替リスク	498	
3	参照先のクレジット・スプレッド・リスク	31	
4	株式リスク	5	
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	5,354	
7	合計	6,344	1,212

【CVA4】 CVA リスク・エクスポートナーの CVA リスク相当額の変動表

(単位 百万円)

	前期末:2025年3月末 当中間期末:2025年9月末	CVAリスク相当額
1	前期末	7,939
2	当中間期末	8,306
	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)

		2025年 9月末	2024年 9月末	2023年 9月末	2022年 9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)	1,657	2,048	402	258
2	損失の件数	148	35	25	30
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)	1,657	2,048	402	258
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)	1,169	1,924	318	142
7	損失の件数	38	9	7	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)	1,169	1,924	318	142
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)2025年9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。

(単位 百万円,件)

		2021年 9月末	2020年 9月末	2019年 9月末	2018年 9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)	223	131	-	-
2	損失の件数	30	23	-	-
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)	223	131	-	-
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)	121	46	-	-
7	損失の件数	3	3	-	-
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)	121	46	-	-
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)

		2017年 9月末	2016年 9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)	-	-	858
2	損失の件数	-	-	52
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)	-	-	858
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)	-	-	676
7	損失の件数	-	-	11
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)	-	-	676
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)

		2025年9月末	2024年9月末	2023年9月末
1	ILDC	81,928		
2	資産運用収益	665,941	660,981	515,011
3	資金調達費用	592,285	589,043	437,002
4	金利収益資産	6,930,241	6,991,320	8,096,962
5	受取配当金	10,240	11,118	8,407
6	SC	581,821		
7	役務取引等収益	446,448	385,055	314,211
8	役務取引等費用	49,928	44,243	36,964
9	その他業務収益	163,752	225,167	179,101
10	その他業務費用	130,163	187,223	136,077
11	FC	105,827		
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)	96,840	109,711	80,883
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)	8,928	14,987	6,131
14	BI	769,577		
15	BIC	110,309		
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	769,577		
17	除外特例によって除外したBI	-		

【OR3】オペレーション・リスクに対する所要自己資本額の概要

(単位 百万円)

1	BIC	110,309
2	ILM	0.67
3	オペレーション・リスク相当額	74,360
4	オペレーション・リスク・アセットの額	929,506

### 【IRRBB1】金利リスク

(単位 百万円)

		△EVE	
		2025年9月末	2024年9月末
1	上方パラレルシフト	10,501	8,343
2	下方パラレルシフト	21,554	20,114
3	ステーਪ化	12,568	10,375
4	フラット化	555	454
5	短期金利上昇	3,657	1,033
6	短期金利低下	14,265	13,420
7	最大値	21,554	20,114
8	Tier1 資本の額	2025年9月末	2024年9月末
		1,542,917	1,462,684

(注) トレーディング業務以外から生じる金利リスクにかかる損益の変動が当社に与える影響は極めて僅少のため△NIIについては開示を省略しております。

### 【CCyB1】カウンター・シクリカル・バッファー比率に係る国又は地域別の状況

(単位 百万円)

国又は地域	各金融当局が定める比率	カウンター・シクリカル・バッファー比率の計算に用いた当該国又は地域に係る信用リスク・アセットの額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・バッファー比率	カウンター・シクリカル・バッファーの額
オーストラリア	1.00%	93,289		
ベルギー	1.00%	11,585		
フランス	1.00%	5,609		
ドイツ	0.75%	4,878		
香港	0.50%	45,783		
韓国	1.00%	75,808		
ルクセンブルク	0.50%	25,926		
オランダ	2.00%	22,028		
スウェーデン	2.00%	11		
英国	2.00%	84,811		
小計		369,732		
合計		4,194,288	0.10%	7,734

(注)「カウンター・シクリカル・バッファー比率の計算に用いた当該国又は地域に係る信用リスク・アセットの額」については原則最終リスクベースでの算出を行っていますが、一部最終リスク国と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ボージャーの比較

(単位 百万円)

項目番号 (国際様式 (LR1)の 該当番号)	項目	2025年9月末	2024年9月末
1	連結貸借対照表における総資産の額	36,915,300	-
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ボ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(△)	3,770,035	-
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	4,337	-
7	キャッシュ・ブーリング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	▲ 1,269,910	-
8a	デリバティブ取引等に関する額	2,082,672	-
8b	デリバティブ取引等に関連する資産の額(△)	3,352,582	-
9	レポ取引等に関する調整額	▲ 2,450,725	-
9a	レポ取引等に関する額	11,624,451	-
9b	レポ取引等に関する額(△)	14,075,176	-
10	オフ・バランス取引に関する額	228,546	-
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	▲ 383,577	-
12a	Tier1資本に係る調整項目の額(貸倒引当金以外)(△)	281,974	-
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(△)	103,391	-
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。)	1,788	-
13	総エクスボージャーの額	29,273,935	-

【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 %)

項目番号 (国際様式 (LR2)の 該当番号)	項目	2025年9月末	2024年9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	15,723,631	-
2	デリバティブ取引等に関する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する現金で差し入れた変動証拠金の対価の額(△)	103,391	-
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)(△)	281,974	-
7	オン・バランス資産の額 (イ)	15,338,265	-
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	627,926	-
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	521,638	-
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トージャーの額(△)		
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	4,132,407	-
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(△)	3,199,300	-
13	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	2,082,672	-
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	15,452,301	-
15	レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	4,178,795	-
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トージャーの額	350,945	-
17	代理取引のエクスポートージャーの額		
18	レポ取引等に関する額 (ハ)	11,624,451	-
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	800,977	-
20	オフ・バランス取引に係るエクスポートージャーの額への変換調整の額(△)	572,430	-
22	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	228,546	-
連結レバレッジ比率 (5)			
23	資本の額 (ホ)	1,542,917	-
24	総エクスポートージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	29,273,935	-
25	連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	5.27%	-
26	適用する所要連結レバレッジ比率	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 %)

項目 (国際様式 (LR2)の 該当番号)	項目	2025年9月末	2024年9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)			
	総エクスポートの額 (ヘ)	29,273,935	-
	日本銀行に対する預け金の額	3,770,035	-
	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トの額 (ヘ')	33,043,971	-
	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%	-
平均値の開示 (7)			
28	レポ取引等に関する資産の額(控除後)に係る平均値((ト) + (チ))	11,529,924	-
	レポ取引等に関する資産の額に係る平均値 (ト)	14,516,682	-
	レポ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)	2,986,757	-
29	レポ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))	11,273,505	-
14	レポ取引等に関する資産の額に係る四半期末の値 (リ)	15,452,301	-
15	レポ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)	4,178,795	-
30	総エクスポートの額(レポ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)	29,530,355	-
30a	総エクスポートの額(レポ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)	33,300,390	-
31	連結レバレッジ比率(レポ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))	5.22%	-
31a	連結レバレッジ比率(レポ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))	4.63%	-

## ■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	1,410,634 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)	—
	剩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	剩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	未配当の剩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	41 百万円	83 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	130 百万円	235 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2010年7月1日	2011年7月1日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段(23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC 調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2013年2月発行新株予約権	2014年2月発行新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	306 百万円	252 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	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	300 百万円	323 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	354 百万円	258 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	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	400 百万円	385 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	265 百万円	165 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	308 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)	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	251 百万円	752 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	595 百万円	99 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 2,969百万円 Tier2資本に係る基礎項目の額 698百万円	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 29,852百万円 Tier2資本に係る基礎項目の額 7,024百万円
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	—
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)	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 9,740百万円 Tier2資本に係る基礎項目の額 2,291百万円
9	額面総額 (5)	—
10	表示される科目の区分 (6)	非支配株主持分
	連結貸借対照表	
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)	—
	剩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	剩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	未配当の剩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)	24,900 百万円	113,200 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、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社
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
	剩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	剩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	未配当の剩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、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—

以 上