

業務及び財産の状況に関する説明書類 【2019年3月期】

この説明書は、金融商品取引法第46条の4および第57条の16に基づき、全ての営業所若しくは事務所に備え置き、公衆の縦覧に供するため作成したものです。

株式会社大和証券グループ本社
大和証券株式会社

大和証券グループ本社 会社概要

大和証券グループ本社概要・沿革

商号又は名称

株式会社大和証券グループ本社

対象特別金融商品取引業者の商号

大和証券株式会社

金融商品取引法第57条の12第1項の規定による指定を受けた日

2012年5月10日

対象特別金融商品取引業者の登録年月日、届出日、登録番号

登録年月日：2007年9月30日

届出日：2007年11月16日

登録番号：関東財務局長(金商)第108号

本店又は主たる事務所の名称及び所在地

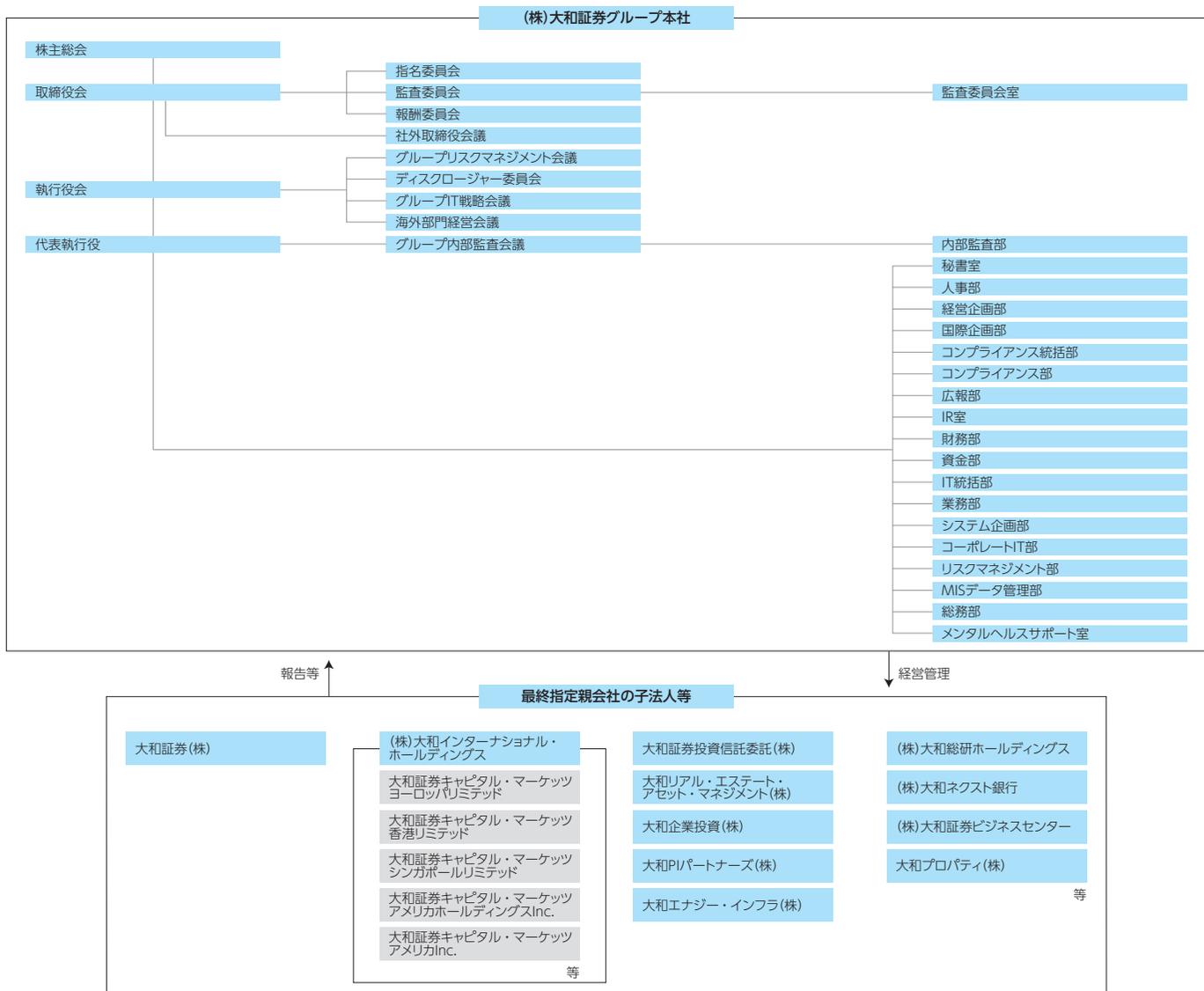
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

沿革(2019年3月31日現在)

年 月	概 要
1943年12月27日	「藤本証券(株)」と「(株)日本信託銀行」が対等合併し、「大和証券(株)」を設立。
1948年10月	証券取引法による証券業者登録。
1949年 4月	東京証券取引所に会員として加入。
1959年 6月	ニューヨーク駐在員事務所開設。
12月	「大和証券投資信託委託(株)」設立。
1961年10月	当社株式を東京、大阪、名古屋の各証券取引所市場第二部に上場。
1964年 4月	ロンドン駐在員事務所開設。
12月	ニューヨークに「大和セキュリティーズアメリカInc.」設立。(現「大和証券キャピタル・マーケットアメリカInc.」)
1968年 4月	改正証券取引法による総合証券会社として、大蔵大臣より免許を受ける。
1970年 2月	当社株式を東京、大阪、名古屋の各証券取引所市場第一部に上場。
12月	香港に「大和証券国際(香港)有限公司」設立。(現「大和証券キャピタル・マーケット香港リミテッド」)
1972年 6月	シンガポールに「DBS・大和セキュリティーズインターナショナルLtd.」設立。(現「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」)
1973年 6月	「大和投資顧問(株)」設立。(現「大和住銀投信投資顧問(株)」)
1975年 8月	「大和コンピューターサービス(株)」設立。(現「(株)大和総研ホールディングス」)
1981年 3月	ロンドンに「大和ヨーロッパリミテッド」設立。(現「大和証券キャピタル・マーケットヨーロッパリミテッド」)
1982年 5月	「(株)大和証券経済研究所」設立。(現「(株)大和総研ホールディングス」)
8月	「日本インベストメント・ファイナンス(株)」設立。(現「(株)大和キャピタル・ホールディングス」)
1983年 8月	「大和システムサービス(株)」設立。(現「(株)大和総研ホールディングス」)
10月	「大和ファイナンス(株)」設立。(現「(株)大和キャピタル・ホールディングス」)
1989年 8月	「大和コンピューターサービス(株)」、「(株)大和証券経済研究所」及び「大和システムサービス(株)」が合併し、「(株)大和総研」発足。(現「(株)大和総研ホールディングス」)
1990年 3月	ニューヨークに「大和アメリカCorporation」設立。(現「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.」)
1994年12月	アムステルダムに「大和証券アジアホールディングB.V.」設立。(現「大和証券キャピタル・マーケットアジアホールディングB.V.」)
1999年 1月	台北に「大和全球証券(股)」設立。(現「大和國泰證券(股)」)
4月	「大和投資顧問(株)」、「住銀投資顧問(株)」及び「エス・ビー・アイ・エム投信(株)」が合併し、「大和住銀投信投資顧問(株)」発足。ホールセール証券業務を「大和証券エスピーキャピタル・マーケット(株)」へ譲渡、同社営業開始。 リテール証券業務を(新)「大和証券(株)」へ譲渡、同社営業開始。(旧)「大和証券(株)」はグループ会社の支配・管理を目的とする持株会社となり、「(株)大和証券グループ本社」に商号変更。
2000年 4月	「大和ファイナンス(株)」が「日本インベストメント・ファイナンス(株)」と合併、「エヌ・アイ・エフ ベンチャーズ(株)」(現「(株)大和キャピタル・ホールディングス」)に商号変更。
2001年 4月	「大和証券エスピーキャピタル・マーケット(株)」がさくら証券(株)から営業全部を譲受け、「大和証券エスエムビーシー(株)」に商号変更。
10月	「大和証券エスエムビーシー(株)」の100%子会社として、「大和証券エスエムビーシープリンシパル・インベストメンツ(株)」を設立。(現「大和PIパートナーズ(株)」)
2002年 3月	「エヌ・アイ・エフ ベンチャーズ(株)」(現「(株)大和キャピタル・ホールディングス」)株式をジャスダック市場に上場。
2005年10月	「エヌ・アイ・エフ ベンチャーズ(株)」が「SMBCキャピタル(株)」と合併、「エヌ・アイ・エフSMBCベンチャーズ(株)」(現「(株)大和キャピタル・ホールディングス」)に商号変更。
2008年10月	(旧)「(株)大和総研」が会社分割による組織再編を行い、(新)「(株)大和総研」と「(株)大和総研ビジネス・イノベーション」を子会社とする持株会社となり、「(株)大和総研ホールディングス」に商号変更。 「エヌ・アイ・エフSMBCベンチャーズ(株)」が「大和SMBCキャピタル(株)」(現「(株)大和キャピタル・ホールディングス」)に商号変更。
2009年 7月	「(株)ダヴィンチ・セレクト」(現「大和リアル・エステート・アセット・マネジメント(株)」)の全株式を取得し、不動産アセットマネジメントビジネスに参入。
9月	「大和SMBCキャピタル(株)」(現「(株)大和キャピタル・ホールディングス」)株式のジャスダック証券取引所における上場を廃止。
2010年 1月	(株)三井住友フィナンシャルグループ及び(株)三井住友銀行とのホールセール証券事業における合併解消に伴い、「大和証券エスエムビーシー(株)」が「大和証券キャピタル・マーケット(株)」に商号変更。
2月	「大和証券エスエムビーシープリンシパル・インベストメンツ(株)」が「大和PIパートナーズ(株)」に商号変更。
7月	「大和SMBCキャピタル(株)」が「(株)大和キャピタル・ホールディングス」に商号変更。

年月	概要
2011年 5月	「(株)大和ネクスト銀行」がお客様向けサービスを開始。
2012年 1月	「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」、「大和証券キャピタル・マーケットズアジアホールディングB.V.」、「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.」を「(株)大和証券グループ本社」の子会社「(株)大和インターナショナル・ホールディングス」の傘下へ移管。
4月	「大和証券(株)」が「大和証券キャピタル・マーケットズ(株)」を吸収合併。
2015年12月	「(株)ミカサ・アセット・マネジメント」の株式を追加取得し、子会社化。
2016年 1月	「(株)IDIインフラストラクチャーズ」の株式を取得し、子会社化。
2017年 9月	「Sagent Holdings, Inc.」の全株式を取得し、子会社化。
10月	「Signal Hill Holdings LLC」の全株式を取得し、子会社化。
2018年 2月	KDDI(株)との合併会社「KDDIアセットマネジメント(株)」発足。
3月	「Sagent Holdings, Inc.」が「Signal Hill Holdings LLC」と統合、「DCS Advisory Holdings, Inc.」(現「Daiwa Corporate Advisory Holdings Inc.」)に商号変更。
4月	「Fintertech(株)」を設立。
7月	「大和エナジー・インフラ(株)」を設立。
10月	「(株)ミカサ・アセット・マネジメント」が「大和リアル・エステート・アセット・マネジメント(株)」と合併。

組織図 (2019年7月1日現在)



●事業の内容

当社グループは、当社及び当社の関係会社(うち連結子会社60社、持分法適用関連会社10社(2019年3月末時点))で構成され、金融商品取引業のほか、銀行法に規定する銀行業その他金融に関する業務、内外経済、金融及び資本市場に関する調査研究及びその受託に係る業務、コンピュータによる計算業務の受託に係る業務、ソフトウェアの開発及び販売に係る業務、不動産の売買・賃貸借及びその仲介に係る業務、貸金業務、信託業務、生命保険の募集及び損害保険代理店業務、その他業務を行っております。

当社は、当社の関係会社の株式・持分を所有することにより、事業活動を支配・管理し、これらの業務に付帯する業務を行っております。

役員一覽

(2019年7月1日現在)

取締役

取締役会長
日比野 隆司

取締役
中田 誠司

取締役
松井 敏浩

取締役
高橋 一夫

取締役
田代 桂子

取締役
小松 幹太

取締役
中川 雅久

取締役
花岡 幸子

社外取締役
小野寺 正

社外取締役
小笠原 倫明

社外取締役
竹内 弘高

社外取締役
西川 郁生

社外取締役
河合 江理子

社外取締役
西川 克行

三委員会

指名委員会
小野寺 正(委員長)

日比野 隆司

中田 誠司

小笠原 倫明

竹内 弘高

河合 江理子

西川 克行

監査委員会
西川 郁生(委員長)

花岡 幸子

小笠原 倫明

河合 江理子

西川 克行

報酬委員会
竹内 弘高(委員長)

日比野 隆司

中田 誠司

小野寺 正

西川 郁生

執行役

代表執行役社長(CEO)
中田 誠司

代表執行役副社長(COO)
松井 敏浩

執行役副社長
高橋 一夫

執行役副社長
田代 桂子

執行役副社長
松下 浩一

執行役副社長
草木 頼幸

専務執行役
小松 幹太

専務執行役(CIO)
中川 雅久

専務執行役
新妻 信介

専務執行役
荻野 明彦

常務執行役(CRO)兼(CDO)
在原 淳一

常務執行役
大塚 祥史

常務執行役(CHO)
白川 香名

執行役(CFO)
佐藤 英二

執行役
日比野 隆司

執行役員

専務執行役員
川上 進次

専務執行役員
岡 裕則

常務執行役員
沢野 隆之

常務執行役員
荒木 秀輝

常務執行役員
村瀬 智之

常務執行役員
柳沢 志向

執行役員
竹内 由紀子

執行役員
鈴木 直樹

執行役員
板屋 篤

株主・株価情報

株式等に係る議決権の保有数の上位10位までの株主又は名称並びにその株式等に係る議決権の保有数及び総株主等の議決権に占める当該株式等に係る議決権の数の割合

(2019年3月31日現在)

株主又は名称	議決権の保有数	割合
日本マスタートラスト信託銀行株式会社（信託口）	99,637千株	6.36%
日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社（信託口）	66,454千株	4.24%
パークレイズ証券株式会社	34,291千株	2.18%
日本生命保険相互会社	31,164千株	1.98%
太陽生命保険株式会社	31,140千株	1.98%
日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社（信託口5）	31,110千株	1.98%
日本郵政株式会社	30,000千株	1.91%
JP MORGAN CHASE BANK 385151	27,317千株	1.74%
STATE STREET BANK WEST CLIENT - TREATY 505234	25,142千株	1.60%
日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社（信託口7）	21,793千株	1.39%

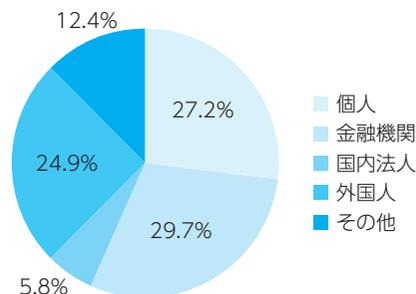
(注1) 持株数は千株未満を切捨てています。

(注2) 持株比率は小数第3位を切捨てています。

(注3) 持株比率は自己株式(133,081,441株)を控除して計算しております。

(注4) 当社は、2019年3月31日現在、自己株式133,081千株を保有しておりますが、上記大株主から除外しております。

所有者別株式分布状況(2019年3月31日現在)



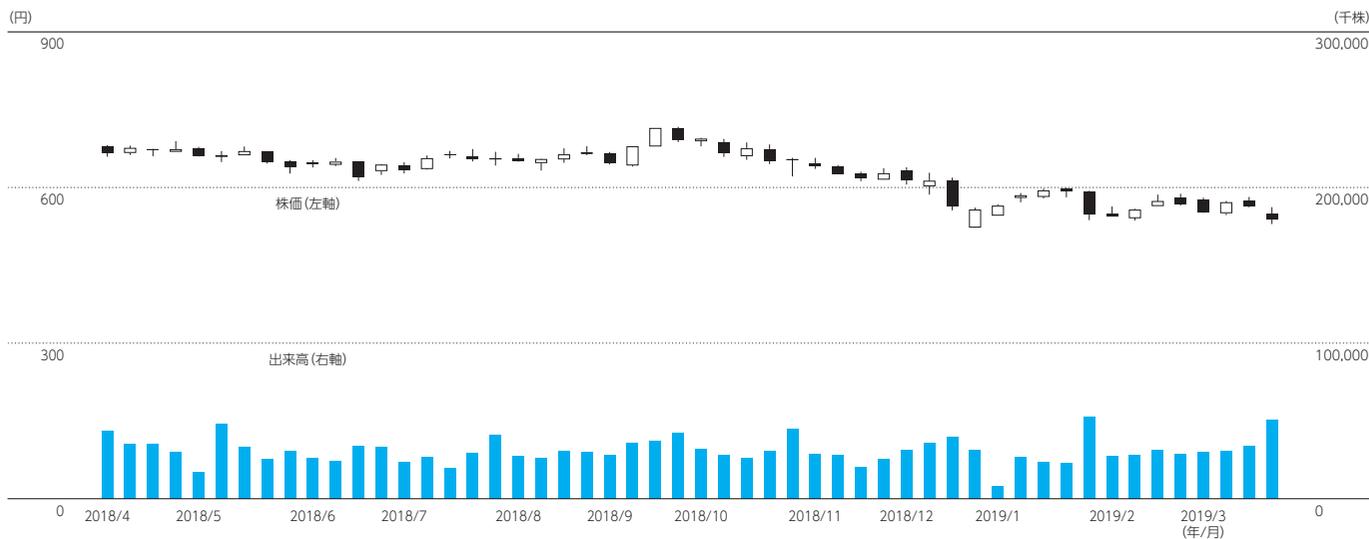
資本金の額 247,397百万円(2019年3月31日現在)

株価情報

東京証券取引所における当社株価(2018年4月1日～2019年3月31日)

始 値	高 値	安 値	終 値	一日平均出来高
678.3円	716.9円	523.7円	539.0円	6,639千株

株価・出来高の推移(2018年4月1日～2019年3月31日)



大和証券グループ本社の子法人等に関する事項

最終指定親会社及びその子法人等の主要な事業の内容及び組織構成(2019年3月31日現在)



(注1) ホールセール部門=グローバル・マーケット+グローバル・インベストメント・バンキング

(注2) 大和住銀投信投資顧問株式会社は、三井住友アセットマネジメント株式会社と合併し、2019年4月1日に三井住友DSアセットマネジメント株式会社となりました。

最終指定親会社の子法人等に関する事項

(2019年3月31日現在)

商号又は名称	本店又は主たる事務所の所在地	資本金の額、基金の総額又は出資の総額	事業の内容	議決権に対する大和証券グループ本社の所有割合(%)	議決権に対する大和証券グループ本社とその子法人等が保有する割合(%)
大和証券株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	100,000百万円	有価証券関連業、投資助言・代理業	100	100
大和証券投資信託委託株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	15,174百万円	投資運用業、投資助言・代理業	100	100
株式会社大和総研ホールディングス	東京都江東区冬木15番6号	3,898百万円	子会社の統合、管理	100	100
株式会社大和総研	東京都江東区冬木15番6号	1,000百万円	情報サービス業	0	100
大和住銀投信投資顧問株式会社(注1)	東京都千代田区霞が関三丁目2番1号	2,000百万円	投資運用業、投資助言・代理業	48.96	48.96
株式会社大和証券ビジネスセンター	東京都江東区東陽二丁目3番2号	100百万円	事務代行業	100	100
大和プロパティ株式会社	東京都中央区京橋一丁目2番1号	100百万円	不動産賃貸業	99.4	100
株式会社大和キャピタル・ホールディングス	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	100百万円	子会社の統合、管理	0	100
大和企业投資株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	100百万円	投資業	0	100
株式会社大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区永代一丁目14番5号	3,000百万円	情報サービス業	0	100
株式会社大和インベストメント・マネジメント	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	500百万円	投資業務	100	100
大和PIパートナーズ株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	12,000百万円	投資業	0	100
大和証券エスエムビーシープリンシパル・インベストメンツ株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	100百万円	投資業	0	60
株式会社大和ファンド・コンサルティング	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	450百万円	投資助言・代理業、投資運用業	100	100
大和リアル・エステート・アセット・マネジメント株式会社	東京都中央区銀座六丁目2番1号	200百万円	投資運用業、投資助言・代理業	100	100
大和インベスター・リレーションズ株式会社	東京都中央区京橋一丁目2番1号	—	—	100	100
株式会社大和証券メディアネットワークス	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	—	—	100	100
大和オフィスサービス株式会社	東京都中央区京橋一丁目2番1号	50百万円	資産管理業	100	100
リテラ・クリア証券株式会社	東京都中央区京橋一丁目2番1号	3,794百万円	有価証券関連業	78.22	83.87
株式会社大和ネクスト銀行	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	50,000百万円	銀行業	100	100

商号又は名称	本店又は主たる事務所の所在地	資本金の額、 基金の総額又は 出資の総額	事業の内容	議決権に 対する 大和証券 グループ本社 の所有 割合(%)	議決権に対する 大和証券 グループ本社と その子法人等が 保有する 割合(%)
株式会社マネーパートナーズグループ	東京都港区六本木三丁目2番1号	2,016百万円	子会社の統合、管理	18.511	18.612
アストマックス株式会社	東京都品川区東五反田二丁目10番2号	2,013百万円	投資業	17.17	17.17
大和証券オフィス投資法人	東京都中央区銀座六丁目2番1号	247,876百万円	不動産投資法人	12.06	38.26
のぞみ債権回収株式会社	東京都中央区日本橋本町一丁目9番4号	500百万円	債権管理回収業	0	100
DIRインフォメーションシステムズ株式会社	東京都江東区永代一丁目14番6号	400百万円	情報サービス業	0	100
NIFコーポレート・インベストメンツ株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	10百万円	投資事業	0	100
東京短資株式会社	東京都中央区日本橋室町四丁目4番10号	10,300百万円	短資業	17.43	17.43
大和あおぞらファイナンス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	—	—	—	—
株式会社大和インターナショナル・ホールディングス	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	100百万円	子会社の統合、管理	100	100
Daiwa Capital Markets America Holdings Inc.	Financial Square, 32 Old Slip, New York, NY10005, U.S.A.	621.5百万 米ドル	有価証券関連業	0	100
Daiwa Capital Markets America Inc.	Financial Square, 32 Old Slip, New York, NY10005, U.S.A.	100百万 米ドル	有価証券関連業	0	100
Daiwa Finance Corp.	Financial Square, 32 Old Slip, New York, NY10005, U.S.A.	1百万 米ドル	有価証券関連業	0	100
Daiwa America Strategic Advisors Corporation	Financial Square, 32 Old Slip, New York, NY10005, U.S.A.	25,000 米ドル	有価証券関連業	0	100
DCS Advisory Holdings Inc.	605 Third Avenue 11th Floor New York, NY 10158, U.S.A.	71百万 米ドル	有価証券関連業	0	100
DCS Advisory LLC.	605 Third Avenue 11th Floor New York, NY 10158, U.S.A.	11.8百万 米ドル	有価証券関連業	0	100
Sagent Capital SPV,LLC	605 Third Avenue 11th Floor New York, NY 10158, U.S.A.	0 米ドル	有価証券関連業	0	100
Daiwa Capital Markets Financial Products (Cayman) Ltd	Governors Square, PO Box 32311, Grand Cayman KY1-1209, Cayman Islands.	1,000百万円	ファイナンス業務	0	100
Daiwa Capital Markets Europe Limited	5 King William Street, London EC4N 7AX, United Kingdom	732,121,063 英ポンド	有価証券関連業	0	100
Daiwa Corporate Advisory Holdings Limited	5 King William Street, London EC4N 7DA, United Kingdom	55.4百万 英ポンド	子会社の統合・管理	0	100
Daiwa Corporate Advisory Limited	5 King William Street, London EC4N 7DA, United Kingdom	20百万 英ポンド	アドバイザー業務	0	100
Daiwa Corporate Advisory SAS	17, rue de Surène 75008 Paris, France	1,320,246 ユーロ	アドバイザー業務	0	100
Daiwa Corporate Advisory GmbH	Neue Mainzer Str. 1,D-60311 Frankfurt/Main, Germany	226,042 ユーロ	アドバイザー業務	0	100
Daiwa Capital Markets Hong Kong Limited	One Pacific Place, 88 Queensway, Hong Kong	100百万 香港ドル及び 276,734,230 米ドル	有価証券関連業務	0	100
Daiwa Capital Markets Singapore Limited	7 Straits View, Marina One East Tower, #16-05/06, Singapore 018936	140百万 シンガポールドル	有価証券関連業務	0	100
Daiwa Capital Markets Investment Services Pte Ltd.	7 Straits View, Marina One East Tower, #16-05/06, Singapore 018936	33.6百万 シンガポールドル	有価証券関連業務	0	100
Daiwa Capital Markets Australia Limited	Rialto North Tower, 525 Collins Street, Melbourne, Victoria 3000, Australia	15百万 豪ドル	有価証券関連業務	0	100
Daiwa Capital Markets Stockbroking Limited	Rialto North Tower, 525 Collins Street, Melbourne, Victoria 3000, Australia	5百万 豪ドル	有価証券関連業務	0	100
Daiwa Capital Markets Nominees Limited	Rialto North Tower, 525 Collins Street, Melbourne, Victoria 3000, Australia	5 豪ドル	有価証券関連業務	0	100

商号又は名称	本店又は主たる事務所の所在地	資本金の額、 基金の総額又は 出資の総額	事業の内容	議決権に 対する 大和証券 グループ本社 の所有 割合(%)	議決権に対する 大和証券 グループ本社と その子法人等が 保有する 割合(%)
Daiwa Capital Markets Fast Nominees Limited	Rialto North Tower, 525 Collins Street, Melbourne, Victoria 3000, Australia	5 豪ドル	決済業務	0	100
大和國泰證券股份有限公司	200, Keelung Road, Sec. 1, Taipei, Taiwan, R.O.C.	1,000百万 台湾ドル	有価証券関連業務	0	90
DBP-Daiwa Capital Markets Philippines, Inc.	Paseo de Roxas, Salcedo Village, Makati City, Republic of the Philippines	255百万 ペソ	有価証券関連業務	0	60
Daiwa Capital Markets India Private Ltd.	3, North Avenue Maker Maxity, Bandra-Kurla Complex Bandra East Mumbai - 400051 India	3,589,524,260 インド・ルピー	有価証券関連業務	0	100
Daiwa Securities Capital Markets Korea Co., Ltd.	One IFC, 10 Gukjegeumyung-Ro, Yeongdeungpo-Gu, Seoul 07326, Korea	21,680百万 ウォン	有価証券関連業務	0	100
Daiwa Asset Management (America) Ltd.	Financial Square, 11th Floor 32 Old Slip, New York, NY 10005-3538, U.S.A.	1百万 米ドル	投資運用業	0	100
Daiwa Asset Management (Europe) Ltd	5th Floor, 5 King William Street, London, EC4N 7AX, United Kingdom	0.5百万 英ポンド	投資運用業	0	100
Daiwa Asset Management (H.K.) Limited	28/F, One Pacific Place, 88 Queensway, Hong Kong	15百万 香港ドル	投資運用業	0	100
Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	3 Phillip Street, #16-04 Royal Group Building, Singapore 048693	2百万 シンガポールドル	投資運用業	0	100
Daiwa Asset Management Services Ltd. (Cayman)	PO Box 309, Uglan House, Grand Cayman, KY1-1104, Cayman Islands	50百万円	投資信託等の管理業務	0	100
Daiwa Portfolio Advisory (India) Private Limited	3 North Avenue, Maker Maxity, Bandra Kurla Complex, Bandra (East), Mumbai, 400 051, India	119,510,646 インドルピー	投資運用業	8.9965	100
大和日華(上海)企業諮詢有限公司	1000 Lujiazui Ring Road, Pudong, Shanghai China 200120	0.5百万 米ドル	コンサルティング業務	0	100
Myanmar Securities Exchange Centre Co., Ltd	21-25 Sule Pagoda Road, Yangon, Union of Myanmar	150 億チャット	有価証券関連業務	0	50
DIR-ACE Technology Ltd.	Myanmar Info-Tech, Hlaing Township, Yangon, Myanmar	150万 米ドル	情報サービス業	0	50
Daiwa SB Investments (USA) Ltd.	Financial Square, 32 Old Slip, 11th Floor, New York, NY 10005, U.S.A.	2,049,593 米ドル	投資運用業	0	100
Daiwa SB Investments (UK) Ltd.	5th Floor, 5 King William Street, London, EC4N 7JA, U.K.	3百万 英ポンド	投資運用業	0	100
Daiwa SB Investments (HK) Ltd.	Level 28, One Pacific Place, 88 Queensway, Hong Kong	10百万 香港ドル	投資運用業	0	100
Daiwa SB Investments (Singapore) Ltd.	7 Straits View Marina One East Tower #16-04, Singapore 018936	1百万 シンガポールドル	投資運用業	0	100
Daiwa Corporate Investment Asia Ltd.	22 Floor, Neich Tower, 128 Gloucester Road, Wan Chai, Hong Kong	0.2百万 米ドル	投資事業	0	100
DS Capital International (NI) Ltd.	PO Box 309, Uglan House Grand Cayman, KY1-1104, Cayman Islands	80,000円	投資事業	0	100
湖北高和創業投資管理有限公司	湖北省武漢市武昌区東湖開発区珞瑜路889号	1百万 人民元	ファンドの運営管理	0	60
湖北高和創業投資企業	湖北省武漢市武昌区東湖開発区珞瑜路889号	10百万 人民元	投資事業	0	80
Daiwa Corporate Investment China Fund I L.P.	PO Box 309, Uglan House Grand Cayman, KY1-1104 Cayman Islands	2,500百万円	投資事業	0	100
Daiwa Capital Markets Investments Asia Limited	One Pacific Place, 88 Queensway, Hong Kong	—	—	—	—
Daiwa Capital Markets Investments Hong Kong Limited	One Pacific Place, 88 Queensway, Hong Kong	—	—	—	—

商号又は名称	本店又は主たる事務所の所在地	資本金の額、 基金の総額又は 出資の総額	事業の内容	議決権に 対する 大和証券 グループ本社 の所有 割合 (%)	議決権に対する 大和証券 グループ本社と その子法人等が 保有する 割合 (%)
DIR XunHe Business Innovation (Hong Kong) Limited (訊和創新有限公司)	148 Connaught Road Central, Hong Kong	—	—	—	—
NIF-PAMA企業支援ファンドA号 投資事業有限責任組合	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	10,700百万円	投資事業	0	100
東日本大震災中小企業復興支援 投資事業有限責任組合	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	8,800百万円	投資事業	0	100
東京都ベンチャー企業成長支援 投資事業有限責任組合	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	2,500百万円	投資事業	0	100
DCIハイテック製造業成長支援 投資事業有限責任組合	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	3,000百万円	投資事業	0	100
大和あおぞらメザニン1号投資事業組合	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	1,200百万円	投資事業	0	50.01
有限会社エル・ピー・シー	東京都渋谷区渋谷二丁目14番13号	—	—	—	—
有限会社ブルーデージー	東京都中央区日本橋三丁目5番12号	—	—	—	—
有限会社ローズマリー	東京都港区新橋二丁目13番8号	—	—	—	—
有限会社ワイ・エス・アール・ツー	東京都中央区日本橋三丁目5番12号	—	—	—	—
有限会社エヌ・エル・シー	東京都中央区日本橋三丁目5番12号	—	—	—	—
有限会社ディー・エス・エムインベストメントラムダ	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	—	—	—	—
合同会社カンブリア	東京都中央区日本橋三丁目5番12号	—	—	—	—
株式会社日本海企業支援ファンド	東京都中央区日本橋三丁目5番12号	—	—	—	—
大和チャレンジファンド株式会社	東京都中央区日本橋三丁目5番12号	—	—	—	—
合同会社DKエナジー	東京都港区虎ノ門三丁目22番10	—	—	—	—
株式会社ブルーエルフィン	東京都中央区日本橋三丁目5番12号	—	—	—	—
株式会社十八チャレンジファンド	東京都中央区日本橋三丁目5番12号	—	—	—	—
合同会社岩見沢太陽光発電	北海道岩見沢市有明町南1番地29	—	—	—	—
合同会社DSエナジー	東京都港区虎ノ門三丁目22番10	—	—	—	—
株式会社シオン	東京都中央区日本橋三丁目5番12号	—	—	—	—
株式会社ホームドクターファンド	東京都中央区日本橋三丁目5番12号	—	—	—	—
合同会社ブルースター	東京都中央区日本橋三丁目5番12号	—	—	—	—
DCIパートナーズ株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	50百万円	投資運用業	0	100
Accordia Golf Trust Management Pte. Ltd.	80 Robinson Road, #22-03A, Singapore 068898	—	—	—	—
大和ベンチャー1号投資事業有限責任組合	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	5,100百万円	投資事業	0	100
DMS Ltd.	Unit516, Sakura Residence, No.9,Inya Road, Kamaryut Township, Yangon, Myanmar	4,496,691 米ドル	情報サービス業	0	100
Howard Holdings Pte. Ltd.	1 Raffles Place, #13-01, One Raffles Place, Singapore (048616)	—	—	—	—
Yangon Stock Exchange Joint-Venture Company Limited	24-26 Sule Pagoda Road, Kyauktada Township, Yangon, Myanmar	—	—	—	—
大和日台バイオベンチャー投資事業有限責任組合	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	11,608百万円	投資事業	0	100
DCI Vietnam Capital Management Co. Ltd.	PO Box 309, Uglan House Grand Cayman, KY1-1104, Cayman Islands	—	—	—	—
DAIWA-SSIAM Vietnam Growth Fund II L.P.	PO Box 309, Uglan House Grand Cayman, KY1-1104, Cayman Islands	27.04百万 ドル	投資事業	0	100
山形創生ファンド投資事業有限責任組合	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	454百万円	投資事業	0	100
合同会社DRロジスティクス1	東京都中央区日本橋一丁目4番1号	0.4百万円	投資用SPC	—	—
大和スタートアップ支援投資事業有限責任組合	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	1,000百万円	投資事業	0	100
グリーン・サマル株式会社	東京都港区西新橋一丁目13番5号	—	—	—	—
DSグリーン発電米沢合同会社を営業者とする匿名組合出資事業	山形県米沢市直江石堤1870番地1	—	—	—	—
株式会社IDIインフラストラクチャーズ	東京都港区南青山二丁目26番1号	—	—	—	—
十字屋ホールディングス株式会社	東京都中央区日本橋茅場町一丁目6番17号	—	—	—	—

商号又は名称	本店又は主たる事務所の所在地	資本金の額、 基金の総額又は 出資の総額	事業の内容	議決権に 対する 大和証券 グループ本社 の所有 割合(%)	議決権に対する 大和証券 グループ本社と その子法人等が 保有する 割合(%)
SKM合同会社	東京都千代田区丸の内三丁目1番1号	—	—	—	—
HOM合同会社	東京都千代田区丸の内三丁目1番1号	—	—	—	—
SSI Securities Corporation	72 Nguyen Hue St, Ben Nghe Ward, District 1, Hochiminh City, Vietnam	11,701百万円	有価証券関連業務	20.03	20.03
株式会社DG Daiwa Ventures	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	—	—	—	—
日光太陽光発電合同会社	東京都千代田区丸の内三丁目1番1号	—	—	—	—
合同会社ネモフィラ	東京都中央区日本橋三丁目5番12号	—	—	—	—
合同会社キャッツテール	東京都中央区日本橋三丁目5番12号	—	—	—	—
合同会社DAヘルスケア2	東京都港区虎ノ門四丁目3番1号城山トラストタワー33階	—	—	—	—
SBIベネフィット・システムズ株式会社	東京都港区六本木一丁目6番1号	450百万円	確定拠出年金運営管理業務	33.4	33.4
DSバイオガスアルファ合同会社	東京都港区虎ノ門三丁目22番10	—	—	—	—
DSバイオガスベータ合同会社	東京都港区虎ノ門三丁目22番10	—	—	—	—
バイオマス・フューエル株式会社	東京都中央区京橋二丁目7番14号	—	—	—	—
多気太陽光発電合同会社	東京都千代田区丸の内三丁目1番1号	—	—	—	—
株式会社のぞみフィナンシャルホールディングス	東京都中央区日本橋本町一丁目9番4号	1億円	子会社の統合・管理等	0	100
合同会社東京ホテルマネジメント	東京都港区虎ノ門三丁目22番10	—	—	—	—
のぞみファイナンス&コンサルティング株式会社	東京都中央区日本橋本町一丁目9番4号	1億円	貸金業務	0	100
Signal Hill LLC	300 East Lombard Street Suite 1700 Baltimore, Maryland 21202, USA	492,237米ドル	アドバイザー業務	0	100
Daiwa Corporate Advisory India PVT. LTD.	40, Vittal Mallya Road, Bangalore-560 001, Karnataka, India	1,427,010インドルピー	アドバイザー業務	0	50.01
合同会社DRロジスティクス2	東京都中央区日本橋一丁目4番1号	—	—	—	—
合同会社DAヘルスケア3	東京都港区虎ノ門四丁目3番1号	—	—	—	—
Daiwa Capital Markets Deutschland GmbH	Neue Mainzer StraÙe 1, 60311 Frankfurt am Main	35,000,000ユーロ	有価証券関連業務	0	100
湖北通瀛投資基金管理有限公司	中国湖北省武漢市漢陽区龍陽湖東路知音茶城12棟19楼	—	—	—	—
DSグリーン発電和歌山合同会社を営業者とする匿名組合出資事業	和歌山県西牟婁郡上富田町生馬317番地42	—	—	—	—
合同会社東京ホテルマネジメント3	東京都港区虎ノ門三丁目22番10	—	—	—	—
サムティアセットマネジメント株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目8番3号	120百万円	投資運用業務、不動産投資顧問業	33	33
サムティ・レジデンシャル投資法人	東京都千代田区丸の内一丁目8番3号	40,610百万円	投資運用業務	32.55	0.347
KDDIアセットマネジメント株式会社	東京都千代田区西神田三丁目2番1号	1,000百万円	確定拠出年金運営管理業	33.4	0.334
合同会社DAXを営業者とする匿名組合出資事業	東京都品川区東五反田二丁目10番2号	—	—	—	—
合同会社東京ホテルマネジメント2	東京都港区虎ノ門三丁目22番10	—	—	—	—
湖北通瀛株権投資基金合伙企业(有限合伙)	中国湖北省武漢市漢陽区	—	—	—	—
Fintertech株式会社	東京都千代田区一番町5番地	8億円	新規ビジネス創出	100	100
BF Cayman	P.O. BOX 10240, Grand Cayman, KY1-1002, Cayman Islands	USD 26,000,001	金融・投資事業	0	100
大和プライベート・インベストメント1号投資事業有限責任組合	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	21,501百万円	投資事業	0	100
Asian Energy Investments Pte., Ltd.	6 Battery Road #24-01 Singapore 0499909	3,796,547シンガポールドル	ファンドの運営、アドバイザー	50.05	50.05
DCIベンチャー成長支援投資事業有限責任組合	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	10,200百万円	投資事業	0	100
大和エナジー・インフラ株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	500百万円	投資事業	0	100
ダイワGIグリーンファンド合同会社	東京都港区虎ノ門三丁目22番10	—	—	—	—
合同会社博多ホテルマネジメント	東京都中央区日本橋一丁目4番1号	—	—	—	—
大和VCアクセラレータ投資事業有限責任組合	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	39,001百万円	投資事業	0	100

商号又は名称	本店又は主たる事務所の所在地	資本金の額、 基金の総額又は 出資の総額	事業の内容	議決権に 対する 大和証券 グループ本社 の所有 割合(%)	議決権に対する 大和証券 グループ本社と その子法人等が 保有する 割合(%)
Roots Capital Investment Pte.Ltd.	10 Anson Road, #14-06, International Plaza, Singapore 079903	—	—	—	—
合同会社DRロジスティクス3	東京都中央区日本橋一丁目4番1号	—	—	—	—
ACA Investments Pte Ltd	8 Temasek Boulevard #34-02, Suntec Tower Three, Singapore (038988)	—	—	—	—

※資本金の額、基金の総額又は出資の総額については百万円以下は切り捨てとする。

(注1) 大和住銀投信投資顧問株式会社は、三井住友アセットマネジメント株式会社と合併し、2019年4月1日に三井住友DSアセットマネジメント株式会社となりました。

経営成績および財政状態についての経営陣による分析

2018年度のマクロ経済環境

〈海外の状況〉

世界経済は緩やかに拡大しているものの、IMF(国際通貨基金)などの国際機関は、米国のトランプ大統領が保護主義的な通商政策を強力に推進したことで米中間の貿易摩擦が激化し、世界経済の先行きに対する下振れリスクが一段と高まっているとみています。IMFによると、2018年の世界経済成長率は3.6%と前年を下回る伸びにとどまり、2019年は3.3%とさらに鈍化すると見込まれています。2018年の成長率は1年前の予想に比べて下方修正されましたが、その背景には、先進国では、ユーロ圏やイギリス、新興国地域では、中東欧やブラジル、中東・北アフリカなどの低成長がありました。

米国経済は、2018年4-6月期の実質GDP成長率が前期比年率4.2%増と約4年ぶりの高成長となった後、2四半期連続で減速しましたが、2019年1-3月期は同3.1%増と再び加速しました。もっとも、1-3月期の中身をみると、個人消費や設備投資といった民間需要の減速を、輸入の減少に伴う外需の寄与や在庫要因、政府支出がカバーしており、国内最終需要は約3年ぶりの低成長でした。総じてみると、米国経済は、雇用・所得環境が安定して推移していることから、個人消費主導の景気拡大が続いています。しかし、トランプ大統領の政権運営は米国内外の混乱を招いており、先行きに対する懸念が高まっています。米国内では、政府機関の一部閉鎖が起こったように、野党である民主党とトランプ大統領の対立は激しさを増しています。また、対外的には、トランプ大統領の強硬姿勢は、中国にとどまらず、EU(欧州連合)やメキシコ、カナダ、日本などに対しても広がっています。中国以外の各国とは妥協が成立したり、新たな貿易交渉を開始するなど一定の成果を挙げているものの、中国との貿易摩擦の行方はむしろ再び激化する様相が見られます。中国からの輸入品に対する追加関税の対象が更に拡大すれば、輸入コストの増加を通じて米国の家計や企業の負担を増し、米国経済に悪影響を及ぼす恐れがあります。

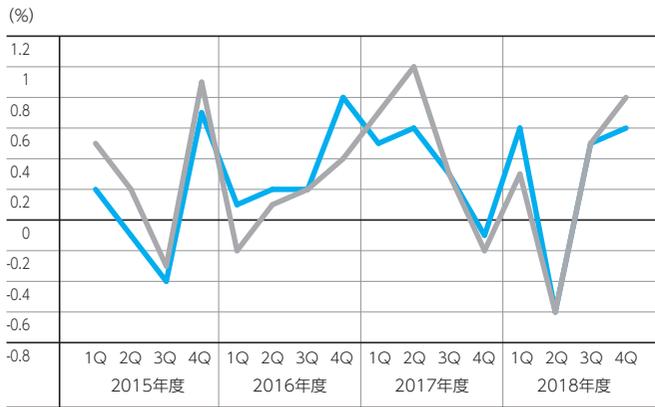
金融面では、底堅い景気拡大を受けて、FRB(連邦準備制度理事会)は2018年に計4回の利上げを実施しました。しかし、先行きの世界経済の減速懸念が強まったことを受けて、2019年に入ると、景気に配慮した姿勢にシフトしました。3月のFOMC(連邦公開市場委員会)では、2019年中の利上げを見送る見通しを示すと同時に、バランスシート縮小を9月末で停止することが決定され、引き締め姿勢を大きく後退させて市場に「ハト派」化したという印象を与えました。

欧州経済(ユーロ圏経済)では、当初の見込みを下回るものの緩やかな成長が続いています。ユーロ圏の実質GDP成長率は、10年ぶりの高成長となった2017年の2.4%から2018年は1.9%となり、特に年後半にかけては、イタリアやドイツ等が明らかに減速しました。その要因としては、米中の貿易摩擦の激化に加え、ユーロ圏と関係が深いトルコなどの新興国の景気減速が重石となり、2018年の後半以降、外需の落ち込みが景気に悪影響を与えたことが挙げられます。2019年1-3月期に入ると、ドイツやスペイン、フランス等の主要国において個人消費を中心に成長が持ち直しました。ただし、鉱工業生産と輸出には下げ止まりの兆しが見られるものの、米中貿易摩擦やイギリスのEU離脱問題の混迷に加えて、EUと米国の通商交渉も控えており、先行きの不透明感は払拭されていません。

金融面では、ECB(欧州中央銀行)は、2018年末まで非伝統的な金融緩和政策の軌道修正を進めてきました。2018年12月末で資産買取を終了し、残高を維持するための再投資を継続しました。しかしながら、世界経済の不透明さが増し、ユーロ圏の景気減速が鮮明になる中で、2019年3月、ECBは次の利上げの可能性を2019年秋から2020年以降に先送りしました。これにより、ECBの金融政策は、非伝統的な金融緩和の終了ではなく継続へ軸足を移したことになります。

新興市場国・発展途上国経済は、成長率が2017年の4.8%から2018年は4.5%に減速しました。世界第2位の経済規模を持つ中国は、2019年1-3月期の実質GDP成長率が6.4%と、2018年10-12月期から横ばいとなり、2018年1-3月期の6.8%を直近のピークとする成長率の低下に歯止めがかかりました。個人消費や総資本形成などの内需の鈍化を、外需の寄与度のプラス転換がカバーしました。ただ、輸出以上に輸入が落ち込んだことが外需の寄与を押し上げたこととみられ、米国との通商摩擦の激化が中国経済に打撃を及ぼしていると考えられます。2019年に入って、中国政府は、景気失速を回避すべく財政・金融の両面から大規模な経済対策を打ち出しており、景気を下支えする効果が期待されます。中国以外の新興国を見ると、原油などの資源価格の上昇は資源国経済にとって追い風になりましたが、世界景気の減速懸念を背景に資源価格は下落に転じ、11月以降、原油価格は前年水準を下回って推移しており、資源国は逆風に直面しています。さらに、米中を中心とした貿易摩擦の激化の影響は世界全体に及んでおり、新興国経済も大きな打撃を受けています。

GDP成長率

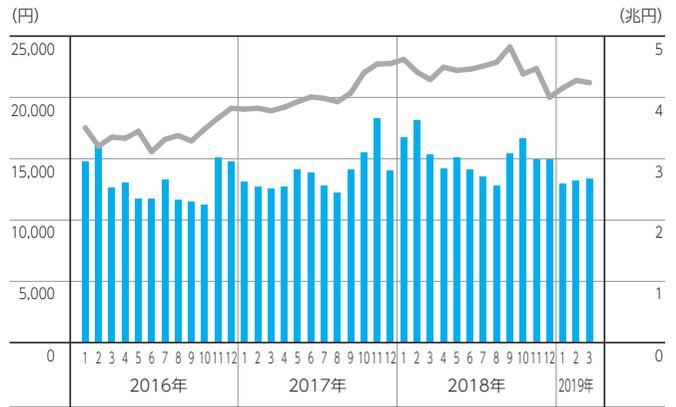


■ 実質GDP ■ 名目GDP

注：データは季節調整済の年率換算値。成長率は総生産から計算したものと一致しないことがある。

出所：内閣府

日経平均株価と東証売買代金



■ 日経平均株価[月末値、左軸] ■ 東証1部・1日平均売買代金[右軸]

出所：東京証券取引所、大和総研

〈日本の状況〉

2018年度の日本経済は、当初は内需を中心に緩やかな回復基調にありましたが、後半は足踏み状態に入りました。2018年7月から9月にかけては、酷暑に加えて、豪雨や台風、大地震といった自然災害が相次いだため、個人消費やインバウンド需要が低迷するとともに、生産・輸送面で企業活動が一時的に制約を受けました。また、2018年度後半には、海外経済の減速を受けて輸出や生産が落ち込み、経済成長率は伸び悩みました。2019年1-3月期の実質GDP成長率は前期比年率2.2%増となりましたが、その内容をみると、輸入の減少に伴う外需の寄与が成長を押し上げており、個人消費や設備投資は振るわず、在庫要因を除くと内需はゼロ成長にとどまりました。この結果、2018年度全体では0.7%の成長と2017年度の1.9%から減速し、4年ぶりの低い伸びとなりました。2017年度は内外需バランスの取れた成長であったのに対して、2018年度は、外需の寄与度が△0.1%ポイントと5年ぶりにマイナスとなり、個人消費や設備投資、住宅投資といった民間需要の伸び率も前年を下回りました。

需要項目ごとに見ると、失業率は低水準で推移し、賃金も緩やかに増加するなど雇用・所得環境の改善が進み、個人消費は、夏場の一連の自然災害による落ち込みから、その後家電販売や旅行、外食などを中心に持ち直しました。もっとも、2019年1-3月期の個人消費は、前期の反動による自動車販売の減少が響き、2四半期ぶりのマイナス成長となりました。住宅投資は、貸家建設の減速感が強まったものの、2019年10月に予定される消費増税に向けた駆け込み需要が徐々に顕在化したことから、2018年7-9月期以降は持ち直しの動きが見られ、3四半期連続で増加しました。

一方、企業の設備投資については、堅調な企業収益や低金利、労働需給の逼迫など企業を取り巻く環境に変化はなく、人手不足に対応した合理化・省人化投資や、競争力を維持するための機械・設備の更新、研究開発投資などが増加しました。しかし、2018年度後半にかけては、海外経済の減速から、情報関連財や資本財を中心に輸出・生産が落ち込みました。中でも、中国などアジア向けの輸出数量は減少しました。また、米中の通商交渉やイギリスのEU離脱の行方など先行きの不透明感が高まったために、企業の景況感は悪化し、設備投資に対する態度にも慎重さが見られるようになりました。引き続き、米国の保護主義的な通商政策によって、世界貿易の縮小につながるリスクがある点には留意が必要です。

金融面では、日本銀行による短期金利に加えて長期金利も操作対象とする金融緩和措置が継続したことから、金利は極めて低位で推移しました。2018年7月末に、日本銀行が長期金利の一定程度の変動を容認する姿勢に転じると、4-6月期にかけて0.05%前後で安定していた10年国債利回りは緩やかに上昇し、8月以降は概ね0.1%台で推移しました。もっとも、12月に入ると、世界

経済の減速懸念を背景に世界的に金利が低下する中、日本の長期金利も大幅に低下し、2019年2月以降は概ねマイナス圏で推移しました。この結果、2019年3月末には10年国債利回りは△0.08%前後と、2016年9月以来の低水準になりました。

株式市場においては、引き続き海外の動向に左右される展開となりました。2018年度前半は、先進国は日米欧いずれも景気が拡大していたことから、株価は上昇基調を辿り、2018年9月下旬から10月初めにかけて日経平均株価は約8ヵ月ぶりに24,000円台を回復し、1991年11月以来の高値を更新しました。しかし、12月には、米中の通商交渉の先行き懸念や、中国をはじめとする世界全体の景気減速懸念の強まりを受けて、世界的な株安となり、日経平均株価は1年3ヵ月ぶりに2万円を割り込みました。2019年に入ると、米欧の中央銀行が景気に配慮した金融政策の姿勢を強め、中国も大規模な景気刺激策を発表したことから、先行きに対する過度な悲観的見方が後退しました。この結果、株価は3月末にかけて再び上昇基調となりました。

一方、為替市場をみると、対ドルでは、2018年度に入って円安・ドル高が進み、5月から6月にかけて概ね109円~111円という狭いレンジで推移しました。7月以降は、米中の貿易摩擦激化への警戒感から円高に振れる場面はあったものの、米国の金利上昇による日米金利差拡大も手伝って円安が進み、10月初めには114円台と約11ヵ月ぶりの円安水準となりました。年末にかけては、先行きの世界経済の減速懸念からリスク回避の動きが強まり、108円台まで円高が進む場面が見られました。そして、2019年に入ると、世界経済の先行きに関する過度に悲観的な見方の後退に伴って円安に回帰し、概ね110~112円で推移しました。また、対ユーロでも対ドルと同様に、2018年末にかけてリスク回避の動きから円高が加速し、2019年1-3月期には円安に振れました。ただ、2019年に入っても、ドル高・ユーロ安のトレンドが続いたことから、対円でみたユーロ高の振れ幅は限定的であり、2018年度全体で見ると、緩やかに円高・ユーロ安が進みました。

2019年3月末の日経平均株価は21,205円81銭(前年3月末比248円49銭安)、10年国債利回りは△0.082%(同0.125ポイントの低下)、為替は1ドル110円75銭(同4円56銭の円安)となりました。

連結損益計算書の分析

〈営業収益・純営業収益〉

当連結会計年度の営業収益は前年度比1.1%増の7,205億円、純営業収益は同12.7%減の4,412億円となりました。

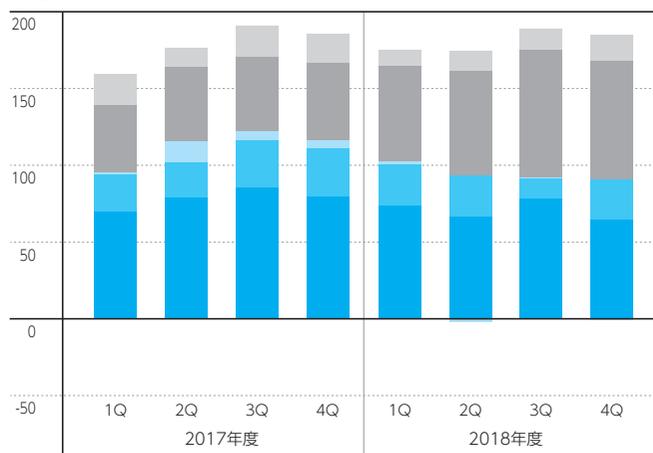
受入手数料は2,830億円と、同9.8%の減収となりました。委託手数料は、日本株取引等の減少により、同21.0%減の583億円となりました。引受業務では、複数の大型エクイティ募集案件等が貢献し、引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料は、同18.8%増の418億円となりました。

純営業収益の内訳

	(百万円)		
	2017年度	2018年度	増減率
営業収益	712,601	720,586	1.1%
受入手数料	313,625	283,027	△9.8%
委託手数料	73,797	58,336	△21.0%
引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料	35,180	41,810	18.8%
募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料	45,807	26,047	△43.1%
その他の受入手数料	158,840	156,833	△1.3%
トレーディング損益	109,005	92,218	△15.4%
営業投資有価証券関連損益	26,912	△232	-
金融収益	190,444	291,005	52.8%
その他の営業収益	72,613	54,567	△24.9%
金融費用	148,348	242,468	63.4%
その他の営業費用	58,901	36,876	△37.4%
純営業収益	505,350	441,240	△12.7%

連結収益の内訳

(十億円)



■ 受入手数料 ■ トレーディング損益 ■ 営業投資有価証券関連損益
■ 金融収益 ■ その他の営業収益

注：各四半期実績については、独立監査人の監査を受けておりません。

〈トレーディング損益の状況〉

トレーディング損益は、外国株及び債券の顧客フロー減少等に伴い大幅な減益となり、前年度比15.4%減の922億円となりました。

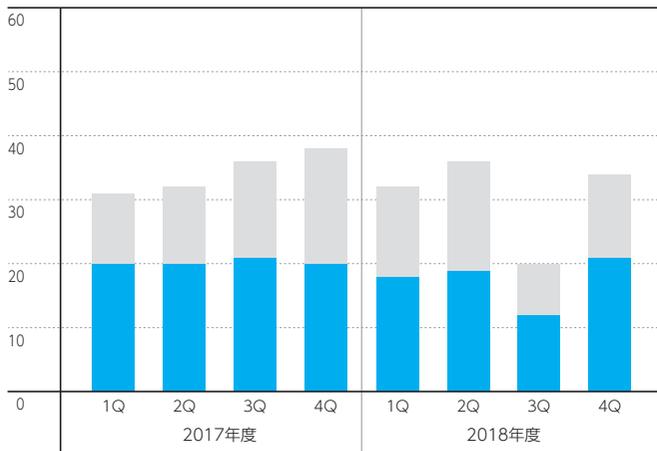
トレーディング損益とトレーディングに伴う金融収支を合計した管理会計ベースのエクイティ収益は同7.1%減の520億円となりました。債券収益は同13.6%減の700億円となりました。

エクイティ・債券収益(トレーディング損益+金融収支、管理会計ベース)

	(十億円)		
	2017年度	2018年度	増減率
エクイティ収益	56.0	52.0	△7.1%
債券収益	81.0	70.0	△13.6%
合計	137.0	122.0	△10.9%

注：管理会計ベースのエクイティ・債券収益については、独立監査人の監査を受けておりません。

エクイティ・債券収益(トレーディング損益+金融収支、管理会計ベース)
(十億円)



■ 債券収益 ■ エクイティ収益

注：管理会計ベースのエクイティ・債券収益については、独立監査人の監査を受けておりません。

〈販売費・一般管理費、経常利益と親会社株主に帰属する当期純利益〉

販売費・一般管理費は前年度比1.0%増の3,739億円となりました。取引関係費は同0.7%減の719億円、人件費は業績に連動する賞与等の減少により同0.2%減の1,854億円、不動産関係費は同4.1%増の373億円、減価償却費は同4.1%増の253億円となっております。

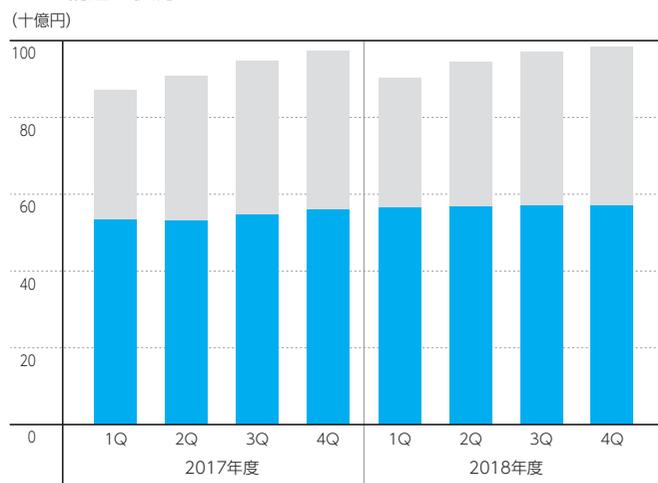
以上より、経常利益は同46.6%減の831億円となりました。

また、投資有価証券売却益等により特別利益が143億円(前年度102億円)、国内子会社のその他事業に係る製品補償関連費用の計上等により特別損失が23億円(前年度120億円)となり、法人税等及び非支配株主に帰属する当期純利益を差し引いた結果、親会社株主に帰属する当期純利益は前年度比42.3%減の638億円となりました。

販売費・一般管理費および収支の内訳

	2017年度	2018年度	増減率
販売費・一般管理費	370,292	373,914	1.0%
取引関係費	72,448	71,933	△0.7%
人件費	185,865	185,436	△0.2%
不動産関係費	35,910	37,394	4.1%
事務費	26,552	26,518	△0.1%
減価償却費	24,336	25,343	4.1%
租税公課	10,732	10,740	0.1%
貸倒引当金繰入れ	—	84	—
その他	14,446	16,461	13.9%
営業利益	135,058	67,326	△50.1%
営業外収支	20,619	15,832	△23.2%
経常利益	155,676	83,159	△46.6%
特別損益	△1,812	11,924	—
税金等調整前当期純利益	153,864	95,083	△38.2%
法人税等合計	38,541	31,251	△18.9%
親会社株主に帰属する当期純利益	110,579	63,813	△42.3%

コスト構造の状況



■ 固定費 ■ 変動費

注：各四半期実績については、独立監査人の監査を受けておりません。

〈セグメント別業績の状況〉

【リテール部門】

市場環境の悪化に伴い、お客様のアクティビティが低下し、特に授信募集手数料が減少した影響で、純営業収益は1,858億円(前期比13.2%減)、経常利益は246億円(同51.9%減)となりました。

【ホールセール部門】

エクイティ引受やM&Aアドバイザーなどの投資銀行業務収益が前期に比べ増加した一方、世界経済の先行き不透明感や、金融市場の低ボラティリティの継続によってグローバル・マーケット業務が低調であったことから、純営業収益は1,589億円(同7.2%減)、経常利益は254億円(同44.0%減)となりました。

【アセット・マネジメント部門】

運用力の強化やラインナップの拡充に注力した一方、株式市場が下期にかけて調整した影響等により、純営業収益は482億円(同2.3%減)、経常利益は283億円(同2.6%減)となりました。

【投資部門】

前期にあった大型投資案件の回収がなかったことに加え、既存投資案件の再評価に伴う損失を計上したことから、純営業収益は17億円(同93.6%減)、経常損失は10億円となりました。

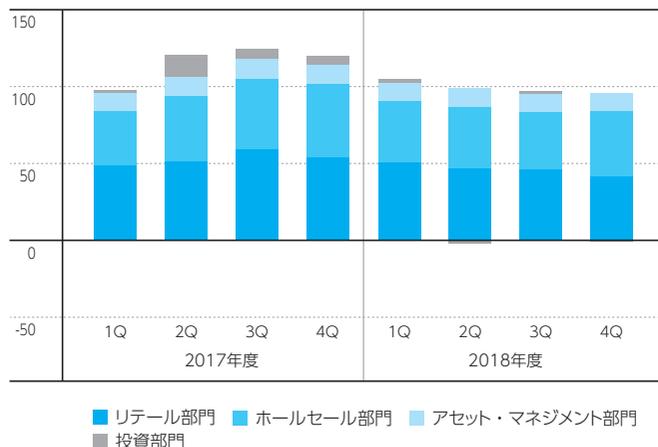
セグメント別業績

	(百万円)					
	純営業収益			経常利益		
	2017年度	2018年度	増減率	2017年度	2018年度	増減率
リテール部門	214,247	185,865	△13.2%	51,331	24,674	△51.9%
ホールセール部門	171,192	158,903	△7.2%	45,373	25,400	△44.0%
アセット・マネジメント部門	49,390	48,232	△2.3%	29,119	28,359	△2.6%
投資部門	27,401	1,766	△93.6%	24,499	△1,093	—
その他・調整	43,118	46,473	—	5,353	5,817	—
連結計	505,350	441,240	△12.7%	155,676	83,159	△46.6%

注：セグメント別の資産の額については、集計しておりません。

純営業収益のセグメント別内訳

(十億円)



注：各四半期実績については、独立監査人の監査を受けておりません。

〈海外部門の状況〉

当連結会計年度においては、前年度に続きM&Aアドバイザー業務の強化を行いました。スペインのMontalbán Atlas Capital, S.L.を買収し、各海外拠点との連携によりクロスボーダー案件や、市場規模が大きい欧米間の案件に対応できる体制をより強化しています。

11月には、北京市傘下の北京国有資本経営管理中心との間で、当社が51%出資する合弁証券会社設立に関する覚書を締結しました。新たに設立する合弁証券会社は、当社のグローバル・ネットワークとノウハウを活かし、クロスボーダービジネスを中心に業務基盤の確立を進め、将来的に当社の中国ビジネスの中核を担う総合証券会社に育てていく考えです。

海外部門の業績は、経常利益で37億円となり、3年連続で通期黒字となりました。

地域別では、欧州はFICC収益やエクイティ引受けに係る収益が減少し19億円の経常損失となりました。

アジア・オセアニアでは、持分法適用関連会社であるSSI証券の利益が貢献したほか、ウェルスマネジメントビジネスも利益に貢献しました。経常利益は前年度比33.5%減の29億円となりました。

米州はDCSアドバイザーでは収益、のれんを含む無形固定資産の償却等の費用がともに増加しました。経常利益は前年度比0.9%増の27億円となりました。

地域別の経常収支

	(百万円)	
	2017年度	2018年度
欧州	4,227	△1,947
アジア・オセアニア	4,433	2,946
米州	2,742	2,766
合計	11,403	3,765

注：各地域の経常収支については、独立監査人の監査を受けておりません。

連結貸借対照表およびキャッシュ・フローの状況

〈資産の部〉

当連結会計年度末の総資産は前年度末比83億円(0.0%)減少の21兆1,267億円となりました。内訳は流動資産が同728億円(0.4%)減少の20兆4,055億円であり、このうち現金・預金が同4,589億円(12.4%)増加の4兆1,532億円、有価証券が同1,748億円(17.7%)減少の8,123億円、トレーディング商品が同490億円(0.7%)増加の6兆7,160億円、営業貸付金が同1,219億円(8.4%)増加の1兆5,648億円、有価証券担保貸付金が同5,229億円(8.0%)減少の5兆9,737億円となっております。固定資産は同645億円(9.8%)増加の7,211億円となっております。

〈負債の部・純資産の部〉

当連結会計年度末の負債合計は前年度末比1,057億円(0.5%)増加の19兆8,702億円となりました。内訳は流動負債が同468億円(0.3%)増加の17兆819億円であり、このうちトレーディング商品が同2,830億円(5.6%)減少の4兆7,477億円、有価証券担保借入金が同1,720億円(3.0%)増加の5兆9,479億円、銀行業における預金が同2,441億円(7.2%)増加の3兆6,325億円、短期借入金が同2,496億円(22.9%)増加の1兆3,414億円となっております。固定負債は同588億円(2.2%)増加の2兆7,843億円であり、このうち社債が同465億円(3.5%)増加の1兆3,619億円、長期借入金が同90億円(0.7%)増加の1兆3,367億円となっております。

当連結会計年度末の純資産合計は同1,140億円(8.3%)減少の1兆2,564億円となりました。資本金及び資本剰余金の合計は4,780億円となりました。利益剰余金は親会社株主に帰属する当期純利益を638億円計上したほか、配当金435億円の支払いを行ったこと等により、同200億円(2.5%)増加の8,057億円となっております。自己株式の控除額は同330億円(60.8%)増加の873億円、その他有価証券評価差額金は同135億円(22.1%)減少の476億円、為替換算調整勘定は同33億円(133.0%)増加の59億円、非支配株主持分は同853億円(96.4%)減少の32億円となっております。

〈キャッシュ・フローの状況〉

当連結会計年度において、営業活動によるキャッシュ・フローは、トレーディング商品の増減、営業貸付金の増減、有価証券担保貸付金及び有価証券担保借入金の増減、銀行業における預金の増減などにより、3,048億円(前年度は△1兆3,192億円)となりました。投資活動によるキャッシュ・フローは、有価証券の売却及び償還による収入などにより、1,082億円(同7,778億円)となりました。財務活動によるキャッシュ・フローは、長期借入れによる収入などにより、557億円(同4,328億円)となりました。これらに為替変動の影響等を加えた結果、当連結会計年度末の現金及び現金同等物の残高は、前年度末比4,686億円増加の4兆1,221億円となりました。

流動性の状況

〈流動性の管理〉

当社グループは、多くの資産及び負債を用いて有価証券関連業務を中心としたビジネスを行っており、ビジネスを継続する上で十分な流動性を効率的かつ安定的に確保することを資金調達の基本方針としております。

当社グループの資金調達手段には、社債、メディアム・ターム・ノート、金融機関借入、コマーシャル・ペーパー、コールマネー、預金受入等の無担保調達、現先取引、レポ取引等の有担保調達があり、これらの多様な調達手段を適切に組み合わせることにより、効率的かつ安定的な資金調達の実現を図っております。

財務の安定性という観点では、環境が大きく変動した場合においても、業務の継続に支障をきたすことのないよう、平時から安定的に資金を確保するよう努めると同時に、危機発生等により、新規の資金調達及び既存資金の再調達が困難となる場合も想定し、調達資金の償還期限及び調達先の分散を図っております。

当社は、平成26年金融庁告示第61号による連結流動性カバレッジ比率(以下、「LCR」という。)の最低基準の遵守が求められております。当社の当第4四半期日次平均のLCRは141.5%となっており、上記金融庁告示による要件を満たしております。また、当社は、上記金融庁告示による規制上のLCRのほかに、独自の流動性管理指標を用いた流動性管理態勢を構築しております。即ち、一定期間内に期日が到来する無担保調達資金及び同期間にストレスが発生した場合の資金流出見込額に対し、様々なストレスシナリオを想定したうえで、それらをカバーする流動性ポートフォリオが保持されていることを日次で確認しております。その他、1年以上の長期間に亘りストレス環境が継続することを想定した場合に、保有資産を維持するための長期性資金調達状況の十分性を計測及びモニタリングしており、1年間無担保資金調達が行えない場合でも業務の継続が可能となるように取り組んでおります。

当第4四半期日次平均のLCRの状況は次のとおりです。

		(単位：億円)
		日次平均 (自 2019年1月 至 2019年3月)
適格流動資産	(A)	25,284
資金流出額	(B)	35,406
資金流入額	(C)	17,545
連結流動性カバレッジ比率(LCR)		
算入可能適格流動資産の合計額	(D)	25,284
純資金流出額	(B)-(C)	17,860
連結流動性カバレッジ比率 (D)/((B)-(C))		141.5%

〈グループ全体の資金管理〉

当社グループでは、グループ全体での適正な流動性確保という基本方針の下、当社が一元的に資金の流動性の管理・モニタリングを行っております。当社は、当社固有のストレス又は市場全体のストレスの発生により新規の資金調達及び既存資金の再調達が困難となる場合も想定し、短期の無担保調達資金について、当社グループの流動性ポートフォリオが十分に確保されているかをモニタリングしております。また、当社は、必要に応じて当社からグループ各社に対し、機動的な資金の配分・供給を行うと共に、グループ内で資金融通を可能とする態勢を整えることで、効率性に基づく一体的な資金調達及び資金管理を行っております。

〈コンティンジェンシー・ファンディング・プラン〉

当社グループは、流動性リスクへの対応の一環として、コンティンジェンシー・ファンディング・プランを策定しております。同プランは、信用力の低下等の内生的要因や金融市場の混乱等の外生的要因によるストレスの逼迫度に応じた報告体制や資金調達手段の確保などの方針を定めており、これにより当社グループは機動的な対応により流動性を確保する態勢を整備しております。

当社グループのコンティンジェンシー・ファンディング・プランは、グループ全体のストレスを踏まえて策定しており、変動する金融環境に機動的に対応するため、定期的な見直しを行っております。

また、金融市場の変動の影響が大きく、その流動性確保の重要性の高い大和証券株式会社、株式会社大和ネクスト銀行及び海外証券子会社においては、更に個別のコンティンジェンシー・ファンディング・プランも策定し、同様に定期的な見直しを行っております。

なお、当社は、子会社のコンティンジェンシー・ファンディング・プランの整備状況について定期的にモニタリングしており、必要に応じて想定すべき危機シナリオを考慮して子会社の資金調達プランやコンティンジェンシー・ファンディング・プランそのもの見直しを行い、更には流動性の積み増しを実行すると同時に資産圧縮を図るといった事前の対策を講ずることとしております。

格付会社による信用格付

大和証券グループ本社及び大和証券には、格付会社より長期及び短期の信用格付が付与されています。当社グループの信用格付に影響を及ぼす要因としては、マクロ経済環境及び主たる事業領域である証券市場等の事業環境、経営戦略、営業基盤、当社グループのマーケットにおける地位、収益性及び収益のボラティリティ、経費構造の柔軟性、リスク管理態勢、流動性の状況、資本政策及び資本の十分性、コーポレート・ガバナンスの状況等が考えられます。

なお、格付が付与された有価証券を発行して資金調達を行うのは、当社グループにおいては大和証券グループ本社及び大和証券です。2019年6月30日現在における2社の格付は次のとおりです。

大和証券グループ本社

格付会社	長期格付	短期格付
ムーディーズ・ジャパン	Baa1	—
スタンダード&プアーズ・レーティング・ジャパン	A-	A-2
格付投資情報センター	A	a-1
日本格付研究所	A+	—

大和証券

格付会社	長期格付	短期格付
ムーディーズ・ジャパン	A3	P-2
スタンダード&プアーズ・レーティング・ジャパン	A	A-1
フィッチ・レーティングス・ジャパン	A-	F1
格付投資情報センター	A	a-1
日本格付研究所	A+	—

連結財務ハイライト

大和証券グループ本社および連結子会社

(単位：百万円(別途記載のものを除く))

	2014年度	2015年度	2016年度	2017年度	2018年度
営業成績					
営業収益	659,396	653,711	616,497	712,601	720,586
受入手数料	291,115	288,418	273,335	313,625	283,027
トレーディング損益	157,220	131,324	128,120	109,005	92,218
営業投資有価証券関連損益	7,415	18,502	14,846	26,912	△232
金融収益	125,934	149,451	143,241	190,444	291,005
その他の営業収益	77,710	66,014	56,953	72,613	54,567
金融費用	80,070	89,530	98,725	148,348	242,468
その他の営業費用	47,105	49,366	45,022	58,901	36,876
純営業収益	532,220	514,815	472,750	505,350	441,240
販売費・一般管理費	361,380	364,517	353,687	370,292	373,914
営業利益又は営業損失(△)	170,839	150,297	119,062	135,058	67,326
経常利益又は経常損失(△)	184,578	165,148	135,623	155,676	83,159
親会社株主に帰属する当期純利益又は当期純損失(△)	148,490	116,848	104,067	110,579	63,813

財政状態(年度末)

総資産	23,001,585	20,420,818	19,827,296	21,135,041	21,126,706
純資産	1,434,680	1,313,005	1,343,433	1,370,520	1,256,430

1株当たり数値(円)

当期純利益又は当期純損失(△) *1	87.07	68.25	61.53	66.88	39.95
純資産	725.27	720.86	745.80	786.56	794.54
配当金	30.00	29.00	26.00	28.00	21.00

連結自己資本規制比率(年度末、億円) *2

自己資本合計	—	—	—	—	—
総自己資本合計(D) = (A) + (B) + (C)	12,117	11,269	11,311	11,423	10,928
普通株式等Tier1資本の額(A)	11,369	11,133	11,311	11,423	10,928
その他Tier1資本の額(B)	359	41	—	—	—
Tier2資本の額(C)	389	94	—	—	—
リスク・アセット合計(E)	57,477	52,913	49,963	51,258	49,532
信用リスク・アセットの額	32,767	28,520	25,796	26,354	24,420
マーケット・リスク相当額を8%で除して得た額	14,603	13,606	13,783	14,615	15,360
オペレーショナル・リスク相当額を8%で除して得た額	10,107	10,788	10,382	10,288	9,750
連結普通株式等Tier1比率(A) / (E)	19.7%	21.0%	22.6%	22.2%	22.0%
連結Tier1比率((A) + (B)) / (E)	20.4%	21.1%	22.6%	22.2%	22.0%
連結自己資本規制比率	—	—	—	—	—
連結総自己資本規制比率(D) / (E)	21.0%	21.2%	22.6%	22.2%	22.0%

*1 1株当たり当期純利益の計算にあたっては、各年度の期中平均株式数を使用

*2 「金融商品取引法第57条の17第1項の規定に基づき、最終指定親会社及びその子法人等の保有する資産等に照らし当該最終指定親会社及びその子法人等の自己資本の充実の状況が適当であるかどうかを判断するための基準（平成22年金融庁告示第130号）」に基づき連結自己資本規制比率を計算しています。

連結財務諸表

連結貸借対照表

(単位：百万円)

科目	2018年3月期 (2018年3月31日現在)	2019年3月期 (2019年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産	20,478,476	20,405,580
現金・預金	3,694,283	4,153,271
預託金	348,912	324,559
受取手形及び売掛金	19,479	18,741
有価証券	987,210	812,341
トレーディング商品	6,667,033	6,716,066
商品有価証券等	4,170,557	3,785,250
デリバティブ取引	2,496,475	2,930,815
営業投資有価証券	115,332	110,034
投資損失引当金	△505	△155
営業貸付金	1,442,939	1,564,856
仕掛品	479	901
信用取引資産	262,963	175,034
信用取引貸付金	231,486	157,309
信用取引借証券担保金	31,476	17,724
有価証券担保貸付金	6,496,752	5,973,771
借入有価証券担保金	6,472,791	5,119,636
現先取引貸付金	23,961	854,135
立替金	17,549	28,503
短期貸付金	388	350
未収収益	35,880	39,229
その他の流動資産	390,020	488,391
貸倒引当金	△244	△317
固定資産	656,565	721,126
有形固定資産	124,190	168,089
建物	43,871	44,864
器具備品	17,394	19,666
土地	57,049	69,521
建設仮勘定	5,875	34,037
無形固定資産	105,776	115,937
のれん	11,170	10,605
借地権	3,218	3,217
ソフトウェア	62,363	76,491
その他	29,023	25,622
投資その他の資産	426,598	437,100
投資有価証券	367,196	374,484
長期貸付金	4,932	5,505
長期差入保証金	17,527	17,448
繰延税金資産	6,162	6,915
その他	31,450	33,408
貸倒引当金	△671	△662
資産合計	21,135,041	21,126,706

(単位：百万円)

科目	2018年3月期 (2018年3月31日現在)	2019年3月期 (2019年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債	17,035,108	17,081,971
支払手形及び買掛金	7,065	7,116
トレーディング商品	5,030,817	4,747,777
商品有価証券等	2,830,472	2,040,196
デリバティブ取引	2,200,345	2,707,580
約定見返勘定	407,184	255,804
信用取引負債	71,344	69,981
信用取引借入金	3,007	3,675
信用取引貸証券受入金	68,336	66,306
有価証券担保借入金	5,775,897	5,947,969
有価証券貸借取引受入金	5,645,028	4,934,115
現先取引借入金	130,868	1,013,853
銀行業における預金	3,388,444	3,632,575
預り金	256,858	276,700
受入保証金	420,039	372,591
短期借入金	1,091,771	1,341,415
コマーシャル・ペーパー	105,000	100,000
1年内償還予定の社債	261,494	190,772
未払法人税等	9,211	5,978
賞与引当金	34,862	28,436
その他の流動負債	175,115	104,852
固定負債	2,725,467	2,784,365
社債	1,315,349	1,361,918
長期借入金	1,327,780	1,336,787
繰延税金負債	9,203	6,071
退職給付に係る負債	41,758	43,441
訴訟損失引当金	24,485	25,573
その他の固定負債	6,889	10,572
特別法上の準備金	3,945	3,938
金融商品取引責任準備金	3,945	3,938
負債合計	19,764,521	19,870,276
(純資産の部)		
株主資本	1,209,535	1,196,476
資本金	247,397	247,397
資本剰余金	230,713	230,633
利益剰余金	785,730	805,761
自己株式	△54,310	△87,320
自己株式申込証拠金	3	5
その他の包括利益累計額	63,597	48,000
その他有価証券評価差額金	61,176	47,668
繰延ヘッジ損益	△129	△5,611
為替換算調整勘定	2,550	5,942
新株予約権	8,790	8,741
非支配株主持分	88,596	3,211
純資産合計	1,370,520	1,256,430
負債・純資産合計	21,135,041	21,126,706

連結損益計算書

(単位：百万円)

科 目	2018年3月期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	2019年3月期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益	712,601	720,586
受入手数料	313,625	283,027
委託手数料	73,797	58,336
引受け・売出し・特定投資家 向け売付け勧誘等の手数料	35,180	41,810
募集・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の取扱手数料	45,807	26,047
その他の受入手数料	158,840	156,833
トレーディング損益	109,005	92,218
営業投資有価証券関連損益	26,912	△232
金融収益	190,444	291,005
その他の営業収益	72,613	54,567
金融費用	148,348	242,468
その他の営業費用	58,901	36,876
純営業収益	505,350	441,240
販売費・一般管理費	370,292	373,914
取引関係費	72,448	71,933
人件費	185,865	185,436
不動産関係費	35,910	37,394
事務費	26,552	26,518
減価償却費	24,336	25,343
租税公課	10,732	10,740
貸倒引当金繰入れ	—	84
その他	14,446	16,461
営業利益	135,058	67,326
営業外収益	21,925	16,562
受取配当金	4,655	4,844
持分法による投資利益	13,235	8,397
為替差益	409	172
その他	3,625	3,147
営業外費用	1,306	729
支払利息	31	27
投資事業組合運用損	153	—
社債発行費	710	85
その他	410	616
経常利益	155,676	83,159

(右上に続く)

連結包括利益計算書

(単位：百万円)

科 目	2018年3月期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	2019年3月期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当期純利益	115,322	63,832
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	658	△13,112
繰延ヘッジ損益	△616	△5,467
為替換算調整勘定	△4,125	3,679
持分法適用会社に対する 持分相当額	387	△737
その他の包括利益合計	△3,696	△15,637
包括利益	111,626	48,194
(内訳)		
親会社株主に係る包括利益	106,923	48,216
非支配株主に係る包括利益	4,702	△22

(単位：百万円)

科 目	2018年3月期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	2019年3月期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
特別利益	10,209	14,320
固定資産売却益	853	149
投資有価証券売却益	5,780	13,128
段階取得に係る差益	1,498	—
金融商品取引責任準備金戻入	—	6
償却債権取立益	481	—
新株予約権戻入益	894	688
移転補償金	—	347
その他	701	—
特別損失	12,022	2,396
固定資産除売却損	483	430
投資有価証券評価損	68	526
持分変動損失	—	178
金融商品取引責任準備金繰入れ	15	—
移転関連費用	2,020	592
事業再編関連費用	193	—
製品補償関連費用	—	631
訴訟損失引当金繰入額	8,996	—
その他	244	37
税金等調整前当期純利益	153,864	95,083
法人税、住民税及び事業税	34,693	27,664
法人税等調整額	3,848	3,587
当期純利益	115,322	63,832
非支配株主に帰属する当期純利益	4,742	18
親会社株主に帰属する当期純利益	110,579	63,813

連結株主資本等変動計算書

2019年3月期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位：百万円)

項目	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金	自己株式	自己株式 申込証拠金	
2018年4月1日残高	247,397	230,713	785,730	△54,310	3	1,209,535
連結会計年度中の変動額						
剰余金の配当	—	—	△43,575	—	—	△43,575
親会社株主に帰属する当期純利益	—	—	63,813	—	—	63,813
自己株式の取得	—	—	—	△34,819	—	△34,819
自己株式の処分	—	—	△207	1,808	—	1,600
その他	—	△80	—	—	1	△79
連結会計年度中の変動額合計	—	△80	20,030	△33,010	1	△13,059
2019年3月31日残高	247,397	230,633	805,761	△87,320	5	1,196,476

項目	その他の包括利益累計額			新株予約権	非支配株主持分
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	為替換算 調整勘定		
2018年4月1日残高	61,176	△129	2,550	8,790	88,596
連結会計年度中の変動額					
株主資本以外の項目の連結会計年度中の変動 額(純額)	△13,508	△5,481	3,392	△48	△85,385
連結会計年度中の変動額合計	△13,508	△5,481	3,392	△48	△85,385
2019年3月31日残高	47,668	△5,611	5,942	8,741	3,211

2018年3月期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位：百万円)

項目	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金	自己株式	自己株式 申込証拠金	
2017年4月1日残高	247,397	230,712	718,238	△12,719	7	1,183,636
連結会計年度中の変動額						
剰余金の配当	—	—	△43,499	—	—	△43,499
親会社株主に帰属する当期純利益	—	—	110,579	—	—	110,579
自己株式の取得	—	—	—	△43,128	—	△43,128
自己株式の処分	—	—	△134	1,537	—	1,403
連結範囲の変動	—	—	546	—	—	546
その他	—	1	—	—	△3	△1
連結会計年度中の変動額合計	—	1	67,491	△41,591	△3	25,898
2018年3月31日残高	247,397	230,713	785,730	△54,310	3	1,209,535

項目	その他の包括利益累計額			新株予約権	非支配株主持分
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	為替換算 調整勘定		
2017年4月1日残高	59,922	435	6,896	8,729	83,813
連結会計年度中の変動額					
株主資本以外の項目の連結会計年度中の変動 額(純額)	1,254	△564	△4,345	61	4,783
連結会計年度中の変動額合計	1,254	△564	△4,345	61	4,783
2018年3月31日残高	61,176	△129	2,550	8,790	88,596

連結キャッシュ・フロー計算書

(単位：百万円)

科 目	2018年3月期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	2019年3月期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業活動によるキャッシュ・フロー		
税金等調整前当期純利益	153,864	95,083
減価償却費	29,242	30,318
のれん償却額	1,309	1,683
貸倒引当金の増減額 (△は減少)	△252	80
金融商品取引責任準備金の 増減額(△は減少)	15	△6
受取利息及び受取配当金	△4,662	△4,893
支払利息	31	27
持分法による投資損益(△は益)	△13,235	△8,397
固定資産除売却損益(△は益)	△370	280
投資有価証券売却損益(△は益)	△5,780	△13,128
段階取得に係る差損益	△1,498	—
持分変動損益(△は益)	—	178
投資有価証券評価損益(△は益)	68	526
訴訟損失引当金繰入額	8,996	—
顧客分別金信託の増減額 (△は増加)	△10,386	15,198
トレーディング商品の増減額	420,402	△580,698
営業投資有価証券の増減額 (△は増加)	5,275	7,199
営業貸付金の増減額(△は増加)	△787,757	△121,875
信用取引資産及び 信用取引負債の増減額	△51,465	86,566
有価証券担保貸付金及び 有価証券担保借入金の増減額	△1,426,684	694,017
短期貸付金の増減額(△は増加)	△44	31
銀行業における預金の増減額 (△は減少)	402,710	244,131
短期差入保証金の増減額 (△は増加)	7,748	△98,004
受入保証金の増減額(△は減少)	1,915	△47,350
預り金の増減額(△は減少)	△126	22,206
その他	△6,204	△8,833
小計	△1,276,886	314,340
利息及び配当金の受取額	10,462	11,303
利息の支払額	△31	△27
法人税等の支払額又は還付額 (△は支払)	△52,793	△20,759
営業活動による キャッシュ・フロー	△1,319,248	304,857

(右上に続く)

(単位：百万円)

科 目	2018年3月期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	2019年3月期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
投資活動によるキャッシュ・フロー		
定期預金の預入による支出	△82,080	△51,478
定期預金の払戻による収入	99,167	64,157
有価証券の取得による支出	△1,034,742	△861,315
有価証券の売却及び 償還による収入	1,874,636	1,067,277
有形固定資産の取得による支出	△7,707	△49,968
有形固定資産の売却による収入	1,094	873
無形固定資産の取得による支出	△31,753	△36,762
投資有価証券の取得による支出	△35,600	△53,667
投資有価証券の売却及び 償還による収入	17,270	42,017
関係会社株式の取得による支出	△16,894	△11,397
関係会社の清算による収入	2,591	—
連結の範囲の変更を伴う 子会社株式の取得による支出	△7,098	△991
貸付けによる支出	△49	△591
貸付金の回収による収入	48	25
その他	△1,009	64
投資活動による キャッシュ・フロー	777,872	108,243
財務活動によるキャッシュ・フロー		
短期借入金の純増減額 (△は減少)	277,128	30,828
長期借入れによる収入	303,055	335,200
長期借入金の返済による支出	△149,284	△116,600
社債の発行による収入	480,614	284,962
社債の償還による支出	△393,429	△318,236
自己株式の売却による収入	1,403	713
自己株式の取得による支出	△43,128	△34,819
配当金の支払額	△43,499	△43,575
非支配株主への払戻による支出	—	△82,697
その他	△44	△34
財務活動による キャッシュ・フロー	432,813	55,741
現金及び現金同等物に係る 換算差額	△5,046	4,425
現金及び現金同等物の増減額 (△は減少)	△113,608	473,267
現金及び現金同等物の期首残高	3,766,145	3,653,464
新規連結に伴う現金及び 現金同等物の増加額	927	—
連結除外に伴う現金及び 現金同等物の減少額	—	△4,629
現金及び現金同等物の期末残高	3,653,464	4,122,102

連結財務諸表の作成について

当社の連結計算書類は、「会社計算規則」(平成18年法務省令第13号)並びに同規則第118条の規定に基づき、当社グループの主たる事業である有価証券関連業を営む会社の貸借対照表及び損益計算書に適用される「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)及び「有価証券関連業経理の統一に関する規則」(昭和49年11月14日付日本証券業協会自主規制規則)に準拠して作成しております。

記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

当社の連結計算書類は、「会社計算規則」(平成18年法務省令第13号)並びに同規則第118条の規定に基づき、当社グループの主たる事業である有価証券関連業を営む会社の貸借対照表及び損益計算書に適用される「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)及び「有価証券関連業経理の統一に関する規則」(昭和49年11月14日付日本証券業協会自主規制規則)に準拠して作成しております。

記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

連結計算書類の作成のための基本となる重要な事項

1. 連結の範囲に関する事項

(1) 連結子会社の数及び主要な連結子会社の名称

連結子会社の数 59社

主要な連結子会社の名称

大和証券株式会社
大和証券投資信託委託株式会社
株式会社大和総研ホールディングス
株式会社大和証券ビジネスセンター
大和プロパティ株式会社
株式会社大和ネクスト銀行
株式会社大和総研
株式会社大和総研ビジネス・イノベーション
大和企業投資株式会社
大和PIパートナーズ株式会社
大和証券エスエムビーシープリンシパル・インベストメンツ株式会社
大和リアル・エステート・アセット・マネジメント株式会社
大和証券キャピタル・マーケティングヨーロッパリミテッド
大和証券キャピタル・マーケティング香港リミテッド
大和証券キャピタル・マーケティングシンガポールリミテッド
大和証券キャピタル・マーケティングアメリカホールディングスInc.
大和証券キャピタル・マーケティングアメリカInc.

当連結会計年度において、連結計算書類に及ぼす重要性が高まったことにより2社、株式の追加取得により4社、新規取得により4社、新規設立により1社を連結の範囲に含めております。また、吸収合併により2社、清算により2社を連結の範囲から除外しております。

(2) 主要な非連結子会社の名称等

主要な非連結子会社の名称

大和インベスター・リレーションズ株式会社

連結の範囲から除いた理由

非連結子会社の総資産、営業収益(又は売上高)、当期純損益(持分に見合う額)及び利益剰余金(持分に見合う額)等それぞれの合計額は、いずれも連結計算書類に及ぼす影響が軽微であり、かつ全体としても重要性がないためであります。

(3) 議決権の過半数を自己の計算において所有している会社等のうち子会社としなかった会社等

当該会社等の数 11社

子会社としなかった主要な会社の名称

株式会社F-Power
株式会社三池火力発電所
株式会社Optimized Energy

子会社としなかった理由

当社の子会社の一部の子会社が、投資育成や事業再生を図りキャピタルゲイン獲得を目的とする営業取引として保有し、企業会計基準適用指針第22号の要件を満たしており、当該会社等の意思決定機関を支配していないことが明らかであると認められるためであります。

(4) 開示対象特別目的会社

開示対象特別目的会社の概要及び開示対象特別目的会社を利用した取引の概要等

一部の連結子会社は、顧客の資金運用ニーズに応える目的で仕組債を販売しており、仕組債の組成に際し特別目的会社を利用しております。この取引において、当該連結子会社は、取得した債券をケイマン法人の特別目的会社に譲渡し、当該特別目的会社は取得した債券を担保とする仕組債を発行しております。当該特別目的会社は7社ですが、いずれの特別目的会社についても、当社及び当該連結子会社は議決権のあ

1. 連結の範囲に関する事項

(1) 連結子会社の数及び主要な連結子会社の名称

連結子会社の数 60社

主要な連結子会社の名称

大和証券株式会社
大和証券投資信託委託株式会社
株式会社大和総研ホールディングス
株式会社大和証券ビジネスセンター
大和プロパティ株式会社
株式会社大和ネクスト銀行
株式会社大和総研
株式会社大和総研ビジネス・イノベーション
大和企業投資株式会社
大和PIパートナーズ株式会社
大和エナジー・インフラ株式会社
大和リアル・エステート・アセット・マネジメント株式会社
大和証券キャピタル・マーケティングヨーロッパリミテッド
大和証券キャピタル・マーケティング香港リミテッド
大和証券キャピタル・マーケティングシンガポールリミテッド
大和証券キャピタル・マーケティングアメリカホールディングスInc.
大和証券キャピタル・マーケティングアメリカInc.

当連結会計年度において、株式の新規取得により1社、新規設立により2社を連結の範囲に含めております。また、連結計算書類に及ぼす重要性が低下したことにより1社、吸収合併により1社を連結の範囲から除外しております。

(2) 主要な非連結子会社の名称等

主要な非連結子会社の名称

大和インベスター・リレーションズ株式会社

連結の範囲から除いた理由

非連結子会社の総資産、営業収益(又は売上高)、当期純損益(持分に見合う額)及び利益剰余金(持分に見合う額)等それぞれの合計額は、いずれも連結計算書類に及ぼす影響が軽微であり、かつ全体としても重要性がないためであります。

(3) 議決権の過半数を自己の計算において所有している会社等のうち子会社としなかった会社等

当該会社等の数 4社

子会社としなかった主要な会社の名称

セカイエ株式会社

子会社としなかった理由

当社の子会社の一部の子会社が、投資育成や事業再生を図りキャピタルゲイン獲得を目的とする営業取引として保有し、企業会計基準適用指針第22号の要件を満たしており、当該会社等の意思決定機関を支配していないことが明らかであると認められるためであります。

(4) 開示対象特別目的会社

開示対象特別目的会社の概要及び開示対象特別目的会社を利用した取引の概要等

一部の連結子会社は、顧客の資金運用ニーズに応える目的で仕組債を販売しており、仕組債の組成に際し特別目的会社を利用しております。この取引において、当該連結子会社は、取得した債券をケイマン法人の特別目的会社に譲渡し、当該特別目的会社は取得した債券を担保とする仕組債を発行しております。当該特別目的会社は8社ですが、いずれの特別目的会社についても、当社及び当該連結子会社は議決権のあ

る出資等は有しておらず、役員や従業員の派遣もありません。なお、当連結会計年度末における特別目的会社の債券の発行額は589,152百万円であります。

2. 持分法の適用に関する事項

(1) 持分法を適用した非連結子会社及び関連会社の数並びに主要な会社等の名称

持分法適用の非連結子会社の数 0社

持分法適用の関連会社の数 10社

主要な持分法適用の関連会社の名称

大和住銀投信投資顧問株式会社

大和証券オフィス投資法人

当連結会計年度において、株式の新規取得により3社を持分法の適用範囲に含めております。また、持分法適用の関連会社に係る株式の追加取得に伴い当該会社が連結子会社となったことにより4社を持分法の適用範囲から除外しております。

持分法適用会社の決算日が連結決算日と異なる会社のうち、1社についてはその他の基準日に実施した仮決算に基づく財務諸表を使用し、その他の会社については当該会社の事業年度に係る財務諸表を使用しております。

(2) 持分法を適用しない非連結子会社及び関連会社の名称等

主要な会社の名称

大和インベスター・リレーションズ株式会社

持分法を適用しない理由

持分法を適用しない非連結子会社及び関連会社の当期純損益(持分に見合う額)、利益剰余金(持分に見合う額)等それぞれの合計額は、いずれも連結計算書類に及ぼす影響が軽微であり、かつ全体としても重要性がないためであります。

(3) 議決権の20%以上、50%以下を自己の計算において所有している会社等のうち関連会社としなかった会社等の名称等

当該会社等の数 8社

関連会社としなかった主要な会社の名称

アルメックスPE株式会社

関連会社としなかった理由

当社の一部の子会社が、投資育成や事業再生を図りキャピタルゲイン獲得を目的とする営業取引として保有し、企業会計基準適用指針第22号の要件を満たしており、当該会社等に重要な影響を与えることができないことが明らかであると認められるためであります。

3. 連結子会社の事業年度等に関する事項

連結子会社の決算日は以下のとおりであります。

3月	50社
12月	9社

連結子会社の決算日が連結決算日と異なる会社のうち、2社については当該会社の決算日現在の財務諸表を使用し、他の7社については連結決算日に実施した仮決算に基づく財務諸表を使用し、連結決算日との間に生じた重要な取引については連結上必要な調整を行っております。

4. 会計方針に関する事項

(1) 重要な資産の評価基準及び評価方法

① トレーディング商品に属する有価証券等の評価基準及び評価方法

連結子会社におけるトレーディング商品に属する有価証券及びデリバティブ取引等については時価法で計上しております。

② トレーディング商品に属さない有価証券等の評価基準及び評価方法

トレーディング商品に属さない有価証券等については以下のとおりであります。

ア 売買目的有価証券

時価法(売却原価は移動平均法により算定)によっております。

イ 満期保有目的の債券

償却原価法によっております。

ウ その他有価証券

時価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)、時価を把握することが極めて困難と認められるもの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。

なお、投資事業有限責任組合等への出資については、当該組合等の

る出資等は有しておらず、役員や従業員の派遣もありません。なお、当連結会計年度末における特別目的会社の債券の発行額は621,348百万円であります。

2. 持分法の適用に関する事項

(1) 持分法を適用した非連結子会社及び関連会社の数並びに主要な会社等の名称

持分法適用の非連結子会社の数 0社

持分法適用の関連会社の数 10社

主要な持分法適用の関連会社の名称

大和住銀投信投資顧問株式会社

大和証券オフィス投資法人

持分法適用会社の決算日が連結決算日と異なる会社のうち、1社についてはその他の基準日に実施した仮決算に基づく財務諸表を使用し、その他の会社については当該会社の事業年度に係る財務諸表を使用しております。

(2) 持分法を適用しない非連結子会社及び関連会社の名称等

主要な会社の名称

大和インベスター・リレーションズ株式会社

持分法を適用しない理由

持分法を適用しない非連結子会社及び関連会社の当期純損益(持分に見合う額)、利益剰余金(持分に見合う額)等それぞれの合計額は、いずれも連結計算書類に及ぼす影響が軽微であり、かつ全体としても重要性がないためであります。

(3) 議決権の20%以上、50%以下を自己の計算において所有している会社等のうち関連会社としなかった会社等の名称等

当該会社等の数 10社

関連会社としなかった主要な会社の名称

アルメックスPE株式会社

関連会社としなかった理由

当社の一部の子会社が、投資育成や事業再生を図りキャピタルゲイン獲得を目的とする営業取引として保有し、企業会計基準適用指針第22号の要件を満たしており、当該会社等に重要な影響を与えることができないことが明らかであると認められるためであります。

3. 連結子会社の事業年度等に関する事項

連結子会社の決算日は以下のとおりであります。

3月	56社
12月	4社

連結子会社の決算日が連結決算日と異なる会社のうち、2社については当該会社の決算日現在の財務諸表を使用し、他の2社については連結決算日に実施した仮決算に基づく財務諸表を使用し、連結決算日との間に生じた重要な取引については連結上必要な調整を行っております。

4. 会計方針に関する事項

(1) 重要な資産の評価基準及び評価方法

① トレーディング商品に属する有価証券等の評価基準及び評価方法

連結子会社におけるトレーディング商品に属する有価証券及びデリバティブ取引等については時価法で計上しております。

② トレーディング商品に属さない有価証券等の評価基準及び評価方法

トレーディング商品に属さない有価証券等については以下のとおりであります。

ア 売買目的有価証券

時価法(売却原価は移動平均法により算定)によっております。

イ 満期保有目的の債券

償却原価法によっております。

ウ その他有価証券

時価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)、時価を把握することが極めて困難と認められるもの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。

なお、投資事業有限責任組合等への出資については、当該組合等の

財務諸表に基づいて、組合等の純資産を出資持分割合に応じて、営業投資有価証券又は投資有価証券として計上しております(組合等の保有する有価証券の評価差額については、その持分相当額を全部純資産直入法により処理しております)。

また、一部の連結子会社における一部の有価証券及び営業投資有価証券については、流動資産の部に計上しております。

エ デリバティブ

時価法によっております。

③たな卸資産の評価基準及び評価方法

仕掛品は、主として個別法による原価法(収益性の低下による簿価切下げの方法)で計上しております。

(2)重要な減価償却資産の減価償却の方法

①有形固定資産

主として定額法によっております。なお、耐用年数については、主として法人税法に規定する方法と同一の基準によっております。

②無形固定資産、投資その他の資産

主として定額法によっております。なお、耐用年数については、主として法人税法に規定する方法と同一の基準によっております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。

(3)重要な引当金の計上基準

①貸倒引当金

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により計上しております。

②投資損失引当金

一部の連結子会社において、当連結会計年度末に有する営業投資有価証券の損失に備えるため、投資先会社の実情を勘案のうえ、その損失見込額を計上しております。

③賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支払いに備えるため、各社所定の計算基準による支払見積額の当連結会計年度負担分を計上しております。

④訴訟損失引当金

証券取引に関する損害賠償請求訴訟等について、今後の損害賠償金の支払いに備えるため、経過状況等に基づく当連結会計年度末における支払見積額を計上しております。

(4)退職給付に係る負債の計上基準

退職給付に係る負債は、当社及び国内連結子会社については、従業員の退職給付に備えるため、社内規程に基づく当連結会計年度末における退職金要支給額を計上しております。これは、当該各社の退職金は将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためであります。その他一部の連結子会社については、当連結会計年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当連結会計年度末において発生していると認められる金額を計上しております。

(5)重要な収益及び費用の計上基準

完成工事高及び完成工事原価の計上基準

一部の国内連結子会社における受注制作ソフトウェアに係る収益については、当連結会計年度末までの進捗部分について成果の確実性が認められる場合については工事進行基準(工事の進捗率の見積りは原価比例法)を、その他の場合については工事完成基準を適用しております。

(6)重要なヘッジ会計の方法

原則として繰延ヘッジ処理によっております。ただし、条件を満たしている場合には、金利変動リスクのヘッジについては金利スワップの特例処理、為替変動リスクのヘッジについては振当処理によっております。

当社及び一部の連結子会社は、一部の有価証券、借入金及び発行社債等に係る金利変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利スワップ及び通貨スワップ等のデリバティブ取引を用いてヘッジを行っております。

ヘッジの有効性の検証については、ヘッジ手段の時価又はキャッシュ・フロー変動の累計額とヘッジ対象の時価又はキャッシュ・フロー変動の累計額とを比較する方法によっております。なお、一部の連結子会社においては、相場変動を相殺するヘッジのうちヘッジ対象とヘッジ手段に関する

財務諸表に基づいて、主として組合等の純資産を出資持分割合に応じて、営業投資有価証券又は投資有価証券として計上しております(組合等の保有する有価証券の評価差額については、その持分相当額を全部純資産直入法により処理しております)。

また、一部の連結子会社における一部の有価証券及び営業投資有価証券については、流動資産の部に計上しております。

エ デリバティブ

時価法によっております。

③たな卸資産の評価基準及び評価方法

仕掛品は、主として個別法による原価法(収益性の低下による簿価切下げの方法)で計上しております。

(2)重要な減価償却資産の減価償却の方法

①有形固定資産

主として定額法によっております。なお、耐用年数については、主として法人税法に規定する方法と同一の基準によっております。

②無形固定資産、投資その他の資産

主として定額法によっております。なお、耐用年数については、主として法人税法に規定する方法と同一の基準によっております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。

(3)重要な引当金の計上基準

①貸倒引当金

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により計上しております。

②投資損失引当金

一部の連結子会社において、当連結会計年度末に有する営業投資有価証券の損失に備えるため、投資先会社の実情を勘案のうえ、その損失見込額を計上しております。

③賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支払いに備えるため、各社所定の計算基準による支払見積額の当連結会計年度負担分を計上しております。

④訴訟損失引当金

証券取引に関する損害賠償請求訴訟等について、今後の損害賠償金の支払いに備えるため、経過状況等に基づく当連結会計年度末における支払見積額を計上しております。

(4)退職給付に係る負債の計上基準

退職給付に係る負債は、当社及び国内連結子会社については、従業員の退職給付に備えるため、社内規程に基づく当連結会計年度末における退職金要支給額を計上しております。これは、当該各社の退職金は将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためであります。その他一部の連結子会社については、当連結会計年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当連結会計年度末において発生していると認められる金額を計上しております。

(5)重要な収益及び費用の計上基準

完成工事高及び完成工事原価の計上基準

一部の国内連結子会社における受注制作ソフトウェアに係る収益については、当連結会計年度末までの進捗部分について成果の確実性が認められる場合については工事進行基準(工事の進捗率の見積りは原価比例法)を、その他の場合については工事完成基準を適用しております。

(6)重要なヘッジ会計の方法

原則として繰延ヘッジ処理によっております。ただし、条件を満たしている場合には、金利変動リスクのヘッジについては金利スワップの特例処理、為替変動リスクのヘッジについては振当処理によっております。

当社及び一部の連結子会社は、一部の有価証券、借入金及び発行社債等に係る金利変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利スワップ及び通貨スワップ等のデリバティブ取引を用いてヘッジを行っております。

ヘッジの有効性の検証については、ヘッジ手段の時価又はキャッシュ・フロー変動の累計額とヘッジ対象の時価又はキャッシュ・フロー変動の累計額とを比較する方法によっております。なお、一部の連結子会社においては、相場変動を相殺するヘッジのうちヘッジ対象とヘッジ手段に関する

2018年3月期

重要な条件がほぼ同一となるようなヘッジ指定を行っているものは、高い有効性があるとみなしており、これをもって有効性の判定に代えております。また、特例処理及び振当処理を採用しているものについては、その判定をもってヘッジの有効性の判定に代えております。

また、銀行業務を行う子会社では、外貨建金融資産・負債から生じる為替変動リスクに対するヘッジ会計の方法は、「銀行業における外貨建取引等の会計処理に関する会計上及び監査上の取扱い」（日本公認会計士協会業種別監査委員会報告第25号 平成14年7月29日）に規定する繰延ヘッジによっております。ヘッジ有効性評価の方法については、外貨建金銭債権債務等の為替変動リスクを減殺する目的で行う通貨スワップ取引及び為替スワップ取引をヘッジ手段とし、ヘッジ対象である外貨建金銭債権債務等に見合うヘッジ手段の外貨ポジション相当額が存在することを確認することによりヘッジの有効性を評価しております。

(7) のれんの償却方法及び償却期間

のれんについては、発生の都度、子会社等の実態に基づいて償却期間を見積り、20年以内の年数で均等償却しております。なお、のれんの金額に重要性が乏しい場合には、発生した連結会計年度に一括して償却しております。

(8) その他連結計算書類作成のための重要な事項

①消費税等の会計処理方法

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

②連結納税制度の適用

当社及び株式会社大和キャピタル・ホールディングスをそれぞれ連結納税親会社とする連結納税制度を適用しております。

2019年3月期

重要な条件がほぼ同一となるようなヘッジ指定を行っているものは、高い有効性があるとみなしており、これをもって有効性の判定に代えております。また、特例処理及び振当処理を採用しているものについては、その判定をもってヘッジの有効性の判定に代えております。

また、銀行業務を行う子会社では、外貨建金融資産・負債から生じる為替変動リスクに対するヘッジ会計の方法は、「銀行業における外貨建取引等の会計処理に関する会計上及び監査上の取扱い」（日本公認会計士協会業種別監査委員会報告第25号 平成14年7月29日）に規定する繰延ヘッジによっております。ヘッジ有効性評価の方法については、外貨建金銭債権債務等の為替変動リスクを減殺する目的で行う通貨スワップ取引及び為替スワップ取引をヘッジ手段とし、ヘッジ対象である外貨建金銭債権債務等に見合うヘッジ手段の外貨ポジション相当額が存在することを確認することによりヘッジの有効性を評価しております。

(7) のれんの償却方法及び償却期間

のれんについては、発生の都度、子会社等の実態に基づいて償却期間を見積り、20年以内の年数で均等償却しております。なお、のれんの金額に重要性が乏しい場合には、発生した連結会計年度に一括して償却しております。

(8) その他連結計算書類作成のための重要な事項

①消費税等の会計処理方法

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

②連結納税制度の適用

当社及び株式会社大和キャピタル・ホールディングスをそれぞれ連結納税親会社とする連結納税制度を適用しております。

表示方法の変更

該当事項はありません。

(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)を当連結会計年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

連結貸借対照表に関する注記

1. 担保に供している資産及び担保に係る債務

(1) 担保に供している資産

現金・預金	200百万円
トレーディング商品	643,776
営業貸付金	407,503
投資有価証券	24,675
計	1,076,155

(注) 上記の金額は連結貸借対照表計上額によっております。なお、上記担保資産の他に、借り入れた有価証券等139,987百万円を担保として差し入れております。

(2) 担保に係る債務

信用取引借入金	3,007百万円
短期借入金	33,000
長期借入金	346,800
計	382,807

(注) 上記の金額は連結貸借対照表計上額によっております。

1. 担保に供している資産及び担保に係る債務

(1) 担保に供している資産

有価証券	43,628百万円
トレーディング商品	558,045
営業貸付金	685,367
投資有価証券	12,513
計	1,299,554

(注) 上記の金額は連結貸借対照表計上額によっております。なお、上記担保資産の他に、借り入れた有価証券等181,124百万円を担保として差し入れております。

(2) 担保に係る債務

信用取引借入金	3,675百万円
短期借入金	422,600
長期借入金	457,800
計	884,075

(注) 上記の金額は連結貸借対照表計上額によっております。

2018年3月期

2. 差し入れた有価証券等の時価

消費貸借契約により貸し付けた有価証券	6,424,650百万円
その他	704,849
計	7,129,500

(注) 1.(1) 担保に供している資産に属するものは除いております。

3. 差し入れを受けた有価証券等の時価

消費貸借契約により借り入れた有価証券	7,526,802百万円
その他	341,175
計	7,867,977

4. 資産から直接控除した貸倒引当金

投資その他の資産・その他	6,296百万円
--------------	----------

5. 有形固定資産の減価償却累計額

114,358百万円

6. 保証債務

被保証者	被保証債務の内容	金額(百万円)
従業員	借入金	90
計		90

7. 特別法上の準備金の計上を規定した法令の条項

金融商品取引責任準備金 金融商品取引法第46条の5第1項

2019年3月期

2. 差し入れた有価証券等の時価

消費貸借契約により貸し付けた有価証券	5,379,208百万円
現先取引で売却した有価証券	1,019,601
その他	474,589
計	6,873,398

(注) 1.(1) 担保に供している資産に属するものは除いております。

3. 差し入れを受けた有価証券等の時価

消費貸借契約により借り入れた有価証券	5,692,767百万円
現先取引で買い付けた有価証券	854,993
その他	296,293
計	6,844,054

4. 資産から直接控除した貸倒引当金

投資その他の資産・その他	6,015百万円
--------------	----------

5. 有形固定資産の減価償却累計額

115,850百万円

6. 保証債務

被保証者	被保証債務の内容	金額(百万円)
従業員	借入金	57
計		57

7. 特別法上の準備金の計上を規定した法令の条項

金融商品取引責任準備金 金融商品取引法第46条の5第1項

連結株主資本等変動計算書に関する注記

1. 当連結会計年度末における発行済株式の種類及び総数

普通株式	1,699,378,772株
------	----------------

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2017年5月16日 取締役会	普通株式	21,804	13	2017年 3月31日	2017年 6月5日
2017年10月25日 取締役会	普通株式	21,695	13	2017年 9月30日	2017年 12月1日
計		43,499			

(2) 基準日が当連結会計年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌連結会計年度となるもの

2018年5月17日開催の取締役会において、普通株式の配当に関する事項を次のとおり決議する予定であります。

①配当金の総額	24,279百万円
②1株当たり配当額	15円
③基準日	2018年3月31日
④効力発生日	2018年6月4日

(注) 配当原資は利益剰余金とする予定であります。

1. 当連結会計年度末における発行済株式の種類及び総数

普通株式	1,699,378,772株
------	----------------

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年5月17日 取締役会	普通株式	24,279	15	2018年 3月31日	2018年 6月4日
2018年10月29日 取締役会	普通株式	19,295	12	2018年 9月30日	2018年 12月3日
計		43,575			

(2) 基準日が当連結会計年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌連結会計年度となるもの

2019年5月16日開催の取締役会において、普通株式の配当に関する事項を次のとおり決議する予定であります。

①配当金の総額	14,096百万円
②1株当たり配当額	9円
③基準日	2019年3月31日
④効力発生日	2019年6月3日

(注) 配当原資は利益剰余金とする予定であります。

2018年3月期

3. 当連結会計年度末の新株予約権の目的となる株式の種類及び数

区分	内訳	新株予約権の目的となる株式の数(株)			当連結会計年度末残高(百万円)	
		当連結会計年度期首	増加	減少		
当社	2006年7月発行新株予約権	154,000	—	20,000	134,000	182
	2007年7月発行新株予約権	186,000	—	12,000	174,000	228
	第4回新株予約権(自己新株予約権)	2,312,000 (257,000)	— (—)	2,312,000 (257,000)	— (—)	— (—)
	2008年7月発行新株予約権	235,000	—	15,000	220,000	213
	第5回新株予約権(自己新株予約権)	2,602,000 (223,000)	— (20,000)	21,000 (—)	2,581,000 (243,000)	632 (—)
	2009年7月発行新株予約権	517,000	—	29,000	488,000	283
	第6回新株予約権(自己新株予約権)	1,903,000 (316,000)	— (3,000)	261,000 (—)	1,642,000 (319,000)	249 (—)
	2010年7月発行新株予約権	926,000	—	42,000	884,000	331
	第7回新株予約権(自己新株予約権)	3,485,000 (486,000)	— (2,000)	556,000 (—)	2,929,000 (488,000)	243 (—)
	2011年7月発行新株予約権	1,111,000	—	19,000	1,092,000	390
	第8回新株予約権(自己新株予約権)	3,395,000 (447,000)	— (5,000)	638,000 (—)	2,757,000 (452,000)	245 (—)
	2013年2月発行新株予約権	789,000	—	5,000	784,000	445
	第9回新株予約権(自己新株予約権)	5,976,000 (357,000)	— (49,000)	806,000 (—)	5,170,000 (406,000)	1,004 (—)
	2014年2月発行新株予約権	388,000	—	3,000	385,000	368
	第10回新株予約権(自己新株予約権)	3,778,000 (186,000)	— (44,000)	44,000 (—)	3,734,000 (230,000)	1,105 (—)
2015年2月発行新株予約権	458,000	—	6,000	452,000	384	
第11回新株予約権(自己新株予約権)	5,219,000 (199,000)	— (65,000)	65,000 (—)	5,154,000 (264,000)	733 (—)	
2016年2月発行新株予約権	581,000	—	3,000	578,000	383	
第12回新株予約権(自己新株予約権)	4,378,000 (106,000)	— (70,000)	70,000 (—)	4,308,000 (176,000)	249 (—)	
2017年2月発行新株予約権	574,000	—	3,000	571,000	404	
第13回新株予約権(自己新株予約権)	7,430,000 (18,000)	— (116,000)	116,000 (—)	7,314,000 (134,000)	240 (—)	
2018年2月発行新株予約権	—	599,000	—	599,000	435	
第14回新株予約権(自己新株予約権)	— (—)	7,462,000 (12,000)	12,000 (—)	7,450,000 (12,000)	34 (—)	
				合計	8,790 (—)	

(注1) 上記の新株予約権の目的となる株式は、全て普通株式であります。

(注2) 「第10回新株予約権」、「第11回新株予約権」、「第12回新株予約権」、「第13回新株予約権」及び「第14回新株予約権」は、権利行使期間の初日が到来していません。

2019年3月期

3. 当連結会計年度末の新株予約権の目的となる株式の種類及び数

区分	内訳	新株予約権の目的となる株式の数(株)			当連結会計年度末残高(百万円)	
		当連結会計年度期首	増加	減少		
当社	2006年7月発行新株予約権	134,000	—	15,000	119,000	162
	2007年7月発行新株予約権	174,000	—	14,000	160,000	209
	2008年7月発行新株予約権	220,000	—	18,000	202,000	196
	第5回新株予約権(自己新株予約権)	2,581,000 (243,000)	— (—)	2,581,000 (243,000)	— (—)	— (—)
	2009年7月発行新株予約権	488,000	—	38,000	450,000	261
	第6回新株予約権(自己新株予約権)	1,642,000 (319,000)	— (4,000)	259,000 (—)	1,383,000 (323,000)	210 (—)
	2010年7月発行新株予約権	884,000	—	64,000	820,000	307
	第7回新株予約権(自己新株予約権)	2,929,000 (488,000)	— (2,000)	331,000 (—)	2,598,000 (490,000)	215 (—)
	2011年7月発行新株予約権	1,092,000	—	56,000	1,036,000	370
	第8回新株予約権(自己新株予約権)	2,757,000 (452,000)	— (8,000)	314,000 (—)	2,443,000 (460,000)	218 (—)
	2013年2月発行新株予約権	784,000	—	46,000	738,000	419
	第9回新株予約権(自己新株予約権)	5,170,000 (406,000)	— (55,000)	172,000 (—)	4,998,000 (461,000)	975 (—)
	2014年2月発行新株予約権	385,000	—	10,000	375,000	358
	第10回新株予約権(自己新株予約権)	3,734,000 (230,000)	— (53,000)	54,000 (—)	3,680,000 (283,000)	1,157 (—)
	2015年2月発行新株予約権	452,000	—	11,000	441,000	375
第11回新株予約権(自己新株予約権)	5,154,000 (264,000)	— (89,000)	89,000 (—)	5,065,000 (353,000)	954 (—)	
2016年2月発行新株予約権	578,000	—	11,000	567,000	376	
第12回新株予約権(自己新株予約権)	4,308,000 (176,000)	— (80,000)	80,000 (—)	4,228,000 (256,000)	357 (—)	
2017年2月発行新株予約権	571,000	—	—	571,000	404	
第13回新株予約権(自己新株予約権)	7,314,000 (134,000)	— (149,000)	149,000 (—)	7,165,000 (283,000)	432 (—)	
2018年2月発行新株予約権	599,000	—	—	599,000	435	
第14回新株予約権(自己新株予約権)	7,450,000 (12,000)	— (163,000)	163,000 (—)	7,287,000 (175,000)	238 (—)	
第15回新株予約権(自己新株予約権)	— (—)	7,469,500 (81,500)	81,500 (—)	7,388,000 (81,500)	105 (—)	
				合計	8,741 (—)	

(注1) 上記の新株予約権の目的となる株式は、全て普通株式であります。

(注2) 「第11回新株予約権」、「第12回新株予約権」、「第13回新株予約権」、「第14回新株予約権」及び「第15回新株予約権」は、権利行使期間の初日が到来していません。

金融商品に関する注記

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社グループは有価証券関連業を中核とする投資・金融サービス業を行っております。具体的には、有価証券及びデリバティブ商品の売買等及び売買等の委託の媒介、有価証券の引受け及び売出し、有価証券の募集及び売出しの取扱い、有価証券の私募の取扱い、その他有価証券関連業並びに銀行業務、金融業等を営んでおります。

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社グループは有価証券関連業を中核とする投資・金融サービス業を行っております。具体的には、有価証券及びデリバティブ商品の売買等及び売買等の委託の媒介、有価証券の引受け及び売出し、有価証券の募集及び売出しの取扱い、有価証券の私募の取扱い、その他有価証券関連業並びに銀行業務、金融業等を営んでおります。

これらの業務において、当社グループでは商品有価証券等、デリバティブ取引、営業投資有価証券、貸出金、投資有価証券等の金融資産・負債を保有するほか、社債、メディアム・ターム・ノート、金融機関借入、預金等による資金調達を行っております。資金調達を行う際には、ビジネスを継続するうえで十分な流動性を効率的に確保するという資金調達の基本方針の下、調達手段及び償還期限の多様化を図りながら、資産と負債の適正なバランスの維持に努め、効率的かつ安定的な資金調達の実現を図っております。また、主に金利スワップ及び通貨スワップ等を金融資産・負債に関する金利変動及び為替変動の影響をヘッジする目的で利用しております。

当社グループでは保有する金融資産・負債から生ずる様々なリスクをその特性に応じて適切に管理し、財務の健全性の維持を図っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

当社グループはトレーディング業務において、①有価証券等(株券・ワラント、債券及び受益証券等)、有価証券担保貸付金・借入金、信用取引資産・負債等、②株価指数先物・債券先物・金利先物及びこれらのオプション取引に代表される取引所取引のデリバティブ商品、③金利スワップ及び通貨スワップ・先物外国為替取引・選択権付債券売買・通貨オプション・FRA・有価証券店頭デリバティブ等の取引所取引以外のデリバティブ商品(店頭デリバティブ取引)等の金融商品を保有しております。また、投資業務において営業投資有価証券等、銀行業務において貸出金・有価証券等を保有するほか、取引関係上の目的等で投資有価証券等の金融商品を保有しております。

これらの金融商品に内在する様々なリスクのうち、主要なものは市場リスクと信用リスクです。市場リスクとは、株式・金利・為替・コモディティ等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指します。また、信用リスクとは、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、あるいは信用力の変化等によって損失を被るリスクを指します。

なお、トレーディング業務において、顧客のニーズに対応するためにしている単独又は仕組債等に組まれたデリバティブ取引の中には、対象資産である株式・金利・為替・コモディティ等の変動並びにそれらの相関に対する変動率が大きいものや、複雑な変動をするものが含まれており、対象資産に比べたリスクが高くなっております。これらのデリバティブ取引は、連結貸借対照表のトレーディング商品等を含めており、また、時価変動による実現・未実現の損益は、トレーディング損益として計上しております。

また、当社グループは金融商品を保有するとともに、社債、メディアム・ターム・ノート、金融機関借入、預金等による資金調達を行っており、流動性リスクに晒されております。流動性リスクとは、市場環境の変化や当社グループの財務内容の悪化等により資金繰りに支障をきたす、あるいは通常よりも著しく高い調達コストを余儀なくされることにより損失を被るリスクを指します。

トレーディング業務を行う証券子会社では、デリバティブ市場における仲介業者及び最終利用者としてデリバティブ取引を利用しております。デリバティブ商品は顧客の様々な金融ニーズに対応するための必要不可欠な商品となっており、仲介業者として顧客の要望に応じるために様々な形で金融商品を提供しております。例えば、顧客の保有する外国債券の為替リスクをヘッジするための先物外国為替取引や、社債発行時の金利リスクをヘッジするための金利スワップの提供等があります。最終利用者としては、当社グループの金融資産・負債に係る金利リスクをヘッジするために金利スワップを利用し、また、トレーディング・ポジションをヘッジするために各種先物取引、オプション取引等を利用しております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社は、リスクアパタイト・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うえで、リスク管理の基本方針、管理すべきリスクの種類、主要リスクごとの担当役員・所管部署等を定めた「リスク管理規程」を取締役会で決定しております。さらに、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います。

子会社はリスク管理の基本方針に基づき、各事業のリスク特性や規模に応じたリスク管理を行い、当社は子会社のリスク管理態勢及びリスクの状

これらの業務において、当社グループでは商品有価証券等、デリバティブ取引、営業投資有価証券、貸出金、投資有価証券等の金融資産・負債を保有するほか、社債、メディアム・ターム・ノート、金融機関借入、コマーシャル・ペーパー、コールマネー、預金受入、現先取引、レポ取引等による資金調達を行っております。資金調達を行う際には、ビジネスを継続するうえで十分な流動性を効率的に確保するという資金調達の基本方針の下、調達手段及び償還期限の多様化を図りながら、資産と負債の適正なバランスの維持に努め、効率的かつ安定的な資金調達の実現を図っております。また、主に金利スワップ及び通貨スワップ等を金融資産・負債に関する金利変動及び為替変動の影響をヘッジする目的で利用しております。

当社グループでは保有する金融資産・負債から生ずる様々なリスクをその特性に応じて適切に管理し、財務の健全性の維持を図っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

当社グループはトレーディング業務において、①有価証券等(株券・ワラント、債券及び受益証券等)、有価証券担保貸付金・借入金、信用取引資産・負債等、②株価指数先物・債券先物・金利先物及びこれらのオプション取引に代表される取引所取引のデリバティブ商品、③金利スワップ及び通貨スワップ・先物外国為替取引・選択権付債券売買・通貨オプション・FRA・有価証券店頭デリバティブ等の取引所取引以外のデリバティブ商品(店頭デリバティブ取引)等の金融商品を保有しております。また、投資業務において営業投資有価証券等、銀行業務において貸出金・有価証券等を保有するほか、取引関係上の目的等で投資有価証券等の金融商品を保有しております。

これらの金融商品に内在する様々なリスクのうち、主要なものは市場リスクと信用リスクです。市場リスクとは、株式・金利・為替・コモディティ等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指します。また、信用リスクとは、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、あるいは信用力の変化等によって損失を被るリスクを指します。

なお、トレーディング業務において、顧客のニーズに対応するためにしている単独又は仕組債等に組まれたデリバティブ取引の中には、対象資産である株式・金利・為替・コモディティ等の変動並びにそれらの相関に対する変動率が大きいものや、複雑な変動をするものが含まれており、対象資産に比べたリスクが高くなっております。これらのデリバティブ取引は、連結貸借対照表のトレーディング商品等を含めており、また、時価変動による実現・未実現の損益は、トレーディング損益として計上しております。

また、当社グループは金融商品を保有するとともに、社債、メディアム・ターム・ノート、金融機関借入、コマーシャル・ペーパー、コールマネー、預金受入、現先取引、レポ取引等による資金調達を行っており、流動性リスクに晒されております。流動性リスクとは、市場環境の変化や当社グループの財務内容の悪化等により資金繰りに支障をきたす、あるいは通常よりも著しく高い調達コストを余儀なくされることにより損失を被るリスクを指します。

トレーディング業務を行う証券子会社では、デリバティブ市場における仲介業者及び最終利用者としてデリバティブ取引を利用しております。デリバティブ商品は顧客の様々な金融ニーズに対応するための必要不可欠な商品となっており、仲介業者として顧客の要望に応じるために様々な形で金融商品を提供しております。例えば、顧客の保有する外国債券の為替リスクをヘッジするための先物外国為替取引や、社債発行時の金利リスクをヘッジするための金利スワップの提供等があります。最終利用者としては、当社グループの金融資産・負債に係る金利リスクをヘッジするために金利スワップを利用し、また、トレーディング・ポジションをヘッジするために各種先物取引、オプション取引等を利用しております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社は、リスクアパタイト・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うえで、リスク管理の基本方針、管理すべきリスクの種類、主要リスクごとの担当役員・所管部署等を定めた「リスク管理規程」を取締役会で決定しております。さらに、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います。

子会社はリスク管理の基本方針に基づき、各事業のリスク特性や規模に応じたリスク管理を行い、当社は子会社のリスク管理態勢及びリスクの状

況をモニタリングしております。また、子会社のモニタリングを通して掌握した子会社のリスクの状況のほか、各社におけるリスク管理態勢上の課題等については、当社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に報告し、審議しております。主要な子会社においてもリスクマネジメント会議等を定期的に開催し、リスク管理の強化を図っております。

①トレーディング目的の金融商品に係るリスク管理

(i) 市場リスクの管理

当社グループのトレーディング業務では、財務状況や対象部門のビジネスプラン・予算等を勘案したうえで、バリュアット・リスク（一定の信頼水準のもとでの最大予想損失額。以下「VaR」という。）、ポジション、感応度等に限度枠を設定しております。当社のリスク管理部署では市場リスクの状況をモニタリングし、経営陣に日次で報告しております。

また、一定期間のデータに基づいて統計的仮定により算出したVaRの限界を補うべく、過去の大幅なマーケット変動に基づくシナリオや、仮想的なストレスイベントに基づくシナリオを用いて、ストレステストを実施しております。

<市場リスクに係る定量的情報>

当社グループにおける主要な証券子会社は、トレーディング商品に関するVaRの算定にあたって、ヒストリカル・シミュレーション法（保有期間1日、信頼区間99%、観測期間520営業日）を採用しております。

連結決算日における当社グループのトレーディング業務のVaRは、全体で11億円であります。

なお、当社グループでは算出されたVaRと損益を比較するバックテストを実行し、モデルの有効性を検証しております。ただし、VaRは過去の相場変動をベースに統計的に算出しており、通常では考えられないほど市場環境が激変する状況下においてはリスクを十分に捕捉できない場合があります。

(ii) 信用リスクの管理

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、事前に取引先の格付等に基づく与信枠を設定し、当該与信枠の遵守状況をモニタリングしております。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は、クレジットスプレッドの変動リスクを中心にモニタリングしております。さらに、大口与信の影響についても定期的なモニタリングをしております。

信用取引においては顧客への与信が発生しますが、担保として定められた委託保証金を徴求しております。また、有価証券貸借取引については、取引先に対する与信枠を設定したうえで、必要な担保を徴求するとともに日々の値洗い等を通じて信用リスクの削減を図っております。

②トレーディング目的以外の金融商品に係るリスク管理

当社グループはトレーディング業務以外でも、投資業務における営業投資有価証券等、銀行業務における貸出金・有価証券等のほか、取引関係上の目的等で投資有価証券等の金融商品を保有しております。これらの金融商品についても市場リスク、信用リスクが生じますが、各業務における特有のリスク特性があるため、それらに応じたリスク管理を行っております。

投資業務を行う子会社では、投資委員会等で投資案件を精査したうえで投資の可否を判断しております。投資後は、投資先の状況を定期的にモニタリングし、リスクマネジメント会議等に報告しています。

銀行業務を行う子会社では、管理すべきリスクカテゴリーを特定し、その管理方針及び管理体制を定めています。また、リスク管理の協議・決定機関として、取締役会の下部組織であるALM委員会（信用・市場・流動性リスク等の管理・運営に関する重要事項を審議）等を設置しています。取締役会やALM委員会等で各種限度額を設定し、その範囲内で業務運営を行うことによりリスクをコントロールしております。

取引関係上の目的等の投資有価証券等は、関連規程等に定められた方針に基づき取得・売却の決定を行います。また、定期的にリスクの状況

況をモニタリングしております。また、子会社のモニタリングを通して掌握した子会社のリスクの状況のほか、各社におけるリスク管理態勢上の課題等については、当社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に報告し、審議しております。主要な子会社においてもリスクマネジメント会議等を定期的に開催し、リスク管理の強化を図っております。

①トレーディング目的の金融商品に係るリスク管理

(i) 市場リスクの管理

当社グループのトレーディング業務では、財務状況や対象部門のビジネスプラン・予算等を勘案したうえで、バリュアット・リスク（一定の信頼水準のもとでの最大予想損失額。以下「VaR」という。）、ポジション、感応度等に限度枠を設定しております。当社のリスク管理部署では市場リスクの状況をモニタリングし、経営陣に日次で報告しております。

また、一定期間のデータに基づいて統計的仮定により算出したVaRの限界を補うべく、過去の大幅なマーケット変動に基づくシナリオや、仮想的なストレスイベントに基づくシナリオを用いて、ストレステストを実施しております。

<市場リスクに係る定量的情報>

当社グループにおける主要な証券子会社は、トレーディング商品に関するVaRの算定にあたって、ヒストリカル・シミュレーション法（保有期間1日、信頼区間99%、観測期間520営業日）を採用しております。

連結決算日における当社グループのトレーディング業務のVaRは、全体で10億円であります。

なお、当社グループでは算出されたVaRと損益を比較するバックテストを実行し、モデルの有効性を検証しております。ただし、VaRは過去の相場変動をベースに統計的に算出しており、通常では考えられないほど市場環境が激変する状況下においてはリスクを十分に捕捉できない場合があります。

(ii) 信用リスクの管理

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います。加えて、取引先リスク全体のリスク量についても限度枠を設定しています。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。

信用取引においては顧客への与信が発生しますが、担保として定められた委託保証金を徴求しております。また、有価証券貸借取引については、取引先に対する与信枠を設定したうえで、必要な担保を徴求するとともに日々の値洗い等を通じて信用リスクの削減を図っております。

②トレーディング目的以外の金融商品に係るリスク管理

当社グループはトレーディング業務以外でも、投資業務における営業投資有価証券等、銀行業務における貸出金・有価証券等のほか、取引関係上の目的等で投資有価証券等の金融商品を保有しております。これらの金融商品についても市場リスク、信用リスクが生じますが、各業務における特有のリスク特性があるため、それらに応じたリスク管理を行っております。

投資業務を行う子会社では、投資委員会等で投資案件を精査したうえで投資の可否を判断しております。投資後は、投資先の状況を定期的にモニタリングし、リスクマネジメント会議等に報告しています。

銀行業務を行う子会社では、管理すべきリスクカテゴリーを特定し、その管理方針及び管理体制を定めています。また、リスク管理の協議・決定機関として、取締役会の下部組織であるALM委員会（信用・市場・流動性リスク等の管理・運営に関する重要事項を審議）等を設置しています。取締役会やALM委員会等で各種限度額を設定し、その範囲内で業務運営を行うことによりリスクをコントロールしております。

取引関係上の目的等の投資有価証券等は、関連規程等に定められた方針に基づき取得・売却の決定を行います。また、定期的にリスクの状況

をモニタリングし、経営陣に報告しております。

<市場リスクに係る定量的情報>

(ア)金融資産及び金融負債(銀行業務を行う子会社が保有する金融資産及び金融負債を除く)

市場リスクの影響を受ける主たる金融資産は投資業務で保有する「営業投資有価証券」、取引関係上の目的で保有する「投資有価証券」となります。なお、2018年3月31日現在、指標となる東証株価指数(TOPIX)等が10%変動したものと想定した場合には「営業投資有価証券」及び「投資有価証券」のうち、時価のある株式等において時価が151億円変動するものと把握しております。

また、市場リスクの影響を受ける主たる金融負債は「社債」及び「長期借入金」であります。なお、2018年3月31日現在、その他全てのリスク変数が一定であると仮定し、金利が10ペーシス・ポイント(0.1%)変動したものと想定した場合、「社債」の時価が23億円、「長期借入金」の時価が3億円それぞれ変動するものと把握しております。

(イ)銀行業務を行う子会社で保有する金融資産及び金融負債

銀行業務を行う子会社では、金融資産及び金融負債について、市場リスク(金利、為替、株式等の様々な市場のリスク・ファクターの変動により、資産・負債(オフ・バランスを含む。))の価値が変動し損失を被るリスク、資産・負債から生み出される収益が変動し損失を被るリスク)の管理にあたり、VaRを用いております。

VaR計測の方法は、ヒストリカル・シミュレーション法(信頼区間99%、観測期間750営業日)を採用しており、売買目的の金融商品は保有期間1日で算出した値を保有期間10日に、売買目的以外の金融商品は保有期間20日で算出した値を保有期間125日に換算した値をVaRとして利用しております。2018年3月31日現在における当該数値は、売買目的の金融商品は2億円、売買目的以外の金融商品は65億円であります。

なお、当該子会社では、リスク計測モデルによって算出されたVaRと仮想損益額との比較を行うバックテストを定期的実施し、当該モデルの有効性を検証しております。2017年度に実施したバックテストの結果、当該子会社が使用するリスク計測モデルは市場リスクを適切に捕捉しているものと認識しております。ただし、VaRは過去の相場変動をベースに統計的に算出しており、通常では考えられないほど市場環境が激変する状況下においてはリスクを十分に捕捉できない場合があります。

このようなVaRによる管理の限界を補完するため、各種シナリオを用いた損失の計測(ストレステスト)を実施しております。

③流動性の管理

当社グループは、多くの資産及び負債を用いて有価証券関連業務を中心としたビジネスを行っており、ビジネスを継続する上で十分な流動性を効率的かつ安定的に確保することを資金調達の基本方針としております。

当社グループの資金調達手段には、社債、メディアム・ターム・ノート、金融機関借入、コマーシャル・ペーパー、コールマネー、預金受入等の無担保調達、現先取引、レボ取引等の有担保調達があり、これらの多様な調達手段を適切に組み合わせることにより、効率的かつ安定的な資金調達の実現を図っております。

財務の安定性という観点では、環境が大きく変動した場合においても、業務の継続に支障をきたすことのないよう、平時から安定的に資金を確保するよう努めております。特に近年においては、世界的金融危機及び信用危機による不測の事態に備え、市場からの資金調達、金融機関からの借入等により、手元流動性の更なる積み増しを行っております。同時に、危機発生等により、新規の資金調達及び既存資金の再調達が困難となる場合も想定し、調達資金の償還期限及び調達先の分散を図っております。

当社は、平成26年金融庁告示第61号による連結流動性カバレッジ比率(以下、「LCR」)の最低基準(2015年3月末から段階的に導入)の遵守が求められております。また、当社は、上記金融庁告示による規制上のLCRのほかに、独自の流動性管理指標を用いた流動性管理態勢を構築しております。即ち、一定期間内に期日が到来する無担保調達資金及び同期間にストレスが発生した場合の資金流出見込額に対し、様々なストレスシナリオを想定したうえで、それらをカバーする流動性ポートフォリオが保持されていることを日次で確認しております。その他、1年以上の長期間に亘りストレス環境が継続することを想定した場合に、保有資産を維持するための長期性資金調達状況の十分性を計測及びモニタリン

をモニタリングし、経営陣に報告しております。

<市場リスクに係る定量的情報>

(ア)金融資産及び金融負債(銀行業務を行う子会社が保有する金融資産及び金融負債を除く)

市場リスクの影響を受ける主たる金融資産は投資業務で保有する「営業投資有価証券」、取引関係上の目的で保有する「投資有価証券」となります。なお、2019年3月31日現在、指標となる東証株価指数(TOPIX)等が10%変動したものと想定した場合には「営業投資有価証券」及び「投資有価証券」のうち、時価のある株式等において時価が99億円変動するものと把握しております。

また、市場リスクの影響を受ける主たる金融負債は「社債」及び「長期借入金」であります。なお、2019年3月31日現在、その他全てのリスク変数が一定であると仮定し、金利が10ペーシス・ポイント(0.1%)変動したものと想定した場合、「社債」の時価が20億円、「長期借入金」の時価が2億円それぞれ変動するものと把握しております。

(イ)銀行業務を行う子会社で保有する金融資産及び金融負債

銀行業務を行う子会社では、金融資産及び金融負債について、市場リスク(金利、為替、株式等の様々な市場のリスク・ファクターの変動により、資産・負債(オフ・バランスを含む。))の価値が変動し損失を被るリスク、資産・負債から生み出される収益が変動し損失を被るリスク)の管理にあたり、VaRを用いております。

VaR計測の方法は、ヒストリカル・シミュレーション法(保有期間20日、信頼区間99%、観測期間750営業日)で算出した値を保有期間125日に換算することとしております。2019年3月31日現在における当該数値は24億円であります。

なお、当該子会社では、リスク計測モデルによって算出されたVaRと仮想損益額との比較を行うバックテストを定期的実施し、当該モデルの有効性を検証しております。2018年度に実施したバックテストの結果、当該子会社が使用するリスク計測モデルは市場リスクを適切に捕捉しているものと認識しております。ただし、VaRは過去の相場変動をベースに統計的に算出しており、通常では考えられないほど市場環境が激変する状況下においてはリスクを十分に捕捉できない場合があります。

このようなVaRによる管理の限界を補完するため、各種シナリオを用いた損失の計測(ストレステスト)を実施しております。

⑤流動性の管理

当社グループは、多くの資産及び負債を用いて有価証券関連業務を中心としたビジネスを行っており、ビジネスを継続するうえで十分な流動性を効率的かつ安定的に確保することを資金調達の基本方針としております。

当社グループの資金調達手段には、社債、メディアム・ターム・ノート、金融機関借入、コマーシャル・ペーパー、コールマネー、預金受入等の無担保調達、現先取引、レボ取引等の有担保調達があり、これらの多様な調達手段を適切に組み合わせることにより、効率的かつ安定的な資金調達の実現を図っております。

財務の安定性という観点では、環境が大きく変動した場合においても、業務の継続に支障をきたすことのないよう、平時から安定的に資金を確保するよう努めると同時に、危機発生等により、新規の資金調達及び既存資金の再調達が困難となる場合も想定し、調達資金の償還期限及び調達先の分散を図っております。

当社は、平成26年金融庁告示第61号による連結流動性カバレッジ比率(以下、「LCR」という。)の最低基準の遵守が求められております。また、当社は、上記金融庁告示による規制上のLCRのほかに、独自の流動性管理指標を用いた流動性管理態勢を構築しております。即ち、一定期間内に期日が到来する無担保調達資金及び同期間にストレスが発生した場合の資金流出見込額に対し、様々なストレスシナリオを想定したうえで、それらをカバーする流動性ポートフォリオが保持されていることを日次で確認しております。その他、1年以上の長期間に亘りストレス環境が継続することを想定した場合に、保有資産を維持するための長期性資金調達状況の十分性を計測及びモニタリングしており、1年間無担保資金調達が行えない場合でも業務の継続が可能となるように取り組んでおります。

当社グループでは、グループ全体での適正な流動性確保という基本方

グしており、1年間無担保資金調達が行えない場合でも業務の継続が可能となるように取り組んでおります。

当社グループでは、グループ全体での適正な流動性確保という基本方針の下、当社が一元的に資金の流動性の管理・モニタリングを行っております。当社は、当社固有のストレス又は市場全体のストレスの発生により新規の資金調達及び既存資金の再調達が困難となる場合も想定し、短期の無担保調達資金について、当社グループの流動性ポートフォリオが十分に確保されているかをモニタリングしております。また、当社は、必要に応じて当社からグループ各社に対し、機動的な資金の配分・供給を行うとともに、グループ内で資金融通を可能とする態勢を整えることで、効率性に基づく一体的な資金調達及び資金管理を行っております。

当社グループは、流動性リスクへの対応の一環として、コンティンジェンシー・ファンディング・プランを策定しております。同プランは、信用力の低下等の内生的要因や金融市場の混乱等の外生的要因によるストレスの逼迫度に応じた報告体制や資金調達手段の確保などの方針を定めており、これにより当社グループは機動的な対応により流動性を確保する態勢を整備しております。

当社グループのコンティンジェンシー・ファンディング・プランは、グループ全体のストレスを踏まえて策定しており、変動する金融環境に機動的に対応するため、定期的な見直しを行っております。

また、金融市場の変動の影響が大きく、その流動性確保の重要性の高い大和証券株式会社、株式会社大和ネクスト銀行及び海外証券子会社においては、更に個別のコンティンジェンシー・ファンディング・プランも策定し、同様に定期的な見直しを行っております。

なお、当社は、子会社のコンティンジェンシー・ファンディング・プランの整備状況について定期的にモニタリングしており、必要に応じて想定すべき危機シナリオを考慮して子会社の資金調達プランやコンティンジェンシー・ファンディング・プランそのものの見直しを行い、更には流動性の積み増しを実行すると同時に資産圧縮を図るといった事前の対策を講じることとしております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が変動することもあります。

針の下、当社が一元的に資金の流動性の管理・モニタリングを行っております。当社は、当社固有のストレス又は市場全体のストレスの発生により新規の資金調達及び既存資金の再調達が困難となる場合も想定し、短期の無担保調達資金について、当社グループの流動性ポートフォリオが十分に確保されているかをモニタリングしております。また、当社は、必要に応じて当社からグループ各社に対し、機動的な資金の配分・供給を行うとともに、グループ内で資金融通を可能とする態勢を整えることで、効率性に基づく一体的な資金調達及び資金管理を行っております。

当社グループは、流動性リスクへの対応の一環として、コンティンジェンシー・ファンディング・プランを策定しております。同プランは、信用力の低下等の内生的要因や金融市場の混乱等の外生的要因によるストレスの逼迫度に応じた報告体制や資金調達手段の確保などの方針を定めており、これにより当社グループは機動的な対応により流動性を確保する態勢を整備しております。

当社グループのコンティンジェンシー・ファンディング・プランは、グループ全体のストレスを踏まえて策定しており、変動する金融環境に機動的に対応するため、定期的な見直しを行っております。

また、金融市場の変動の影響が大きく、その流動性確保の重要性の高い大和証券株式会社、株式会社大和ネクスト銀行及び海外証券子会社においては、更に個別のコンティンジェンシー・ファンディング・プランも策定し、同様に定期的な見直しを行っております。

なお、当社は、子会社のコンティンジェンシー・ファンディング・プランの整備状況について定期的にモニタリングしており、必要に応じて想定すべき危機シナリオを考慮して子会社の資金調達プランやコンティンジェンシー・ファンディング・プランそのものの見直しを行い、更には流動性の積み増しを実行すると同時に資産圧縮を図るといった事前の対策を講じることとしております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が変動することもあります。

2018年3月期

2. 金融商品の時価等に関する事項

当連結会計年度末における連結貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません(注2)に記載のとおりであります)。

(単位：百万円)

	連結貸借 対照表計上額	時価	差額
資産			
(1)現金・預金	3,694,283	3,694,283	—
(2)預託金	348,912	348,912	—
(3)トレーディング商品			
①商品有価証券等	4,170,557	4,170,557	—
②デリバティブ取引	2,496,475	2,496,475	—
(4)営業貸付金	1,442,939		
貸倒引当金	△54		
	1,442,884	1,443,494	609
(5)信用取引資産			
信用取引貸付金	231,486	231,486	—
信用取引借証券担保金	31,476	31,476	—
(6)有価証券担保貸付金			
借入有価証券担保金	6,472,791	6,472,791	—
現先取引貸付金	23,961	23,961	—
(7)有価証券、営業投資有価証券及び投資有価証券			
①売買目的有価証券	11,923	11,923	—
②満期保有目的の債券	111,545	111,961	415
③子会社株式及び関連会社株式	116,809		
投資損失引当金	—		
	116,809	152,071	35,261
④その他有価証券	1,082,945	1,082,945	—
資産計	20,236,053	20,272,340	36,287
負債			
(1)トレーディング商品			
①商品有価証券等	2,830,472	2,830,472	—
②デリバティブ取引	2,200,345	2,200,345	—
(2)約定見返勘定	407,184	407,184	—
(3)信用取引負債			
信用取引借入金	3,007	3,007	—
信用取引貸証券受入金	68,336	68,336	—
(4)有価証券担保借入金			
有価証券貸借取引受入金	5,645,028	5,645,028	—
現先取引借入金	130,868	130,868	—
(5)銀行業における預金	3,388,444	3,388,437	6
(6)預り金	256,858	256,858	—
(7)受入保証金	420,039	420,039	—
(8)短期借入金	1,091,771	1,091,771	—
(9)コマーシャル・ペーパー	105,000	105,000	—
(10)1年内償還予定の社債	261,494	261,494	—
(11)社債	1,315,349	1,319,324	△3,975
(12)長期借入金	1,327,780	1,327,746	34
負債計	19,451,982	19,455,917	△3,934
トレーディングに係るもの以外のデリバティブ取引(※)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	2,397	2,397	—
ヘッジ会計が適用されているもの	2,162	△951	△3,113
トレーディングに係るもの以外のデリバティブ取引計	4,559	1,445	△3,113

※トレーディングに係るもの以外のデリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、△で示しております。

2019年3月期

2. 金融商品の時価等に関する事項

当連結会計年度末における連結貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません(注2)に記載のとおりであります)。

(単位：百万円)

	連結貸借 対照表計上額	時価	差額
資産			
(1)現金・預金	4,153,271	4,153,271	—
(2)預託金	324,559	324,559	—
(3)トレーディング商品			
①商品有価証券等	3,785,250	3,785,250	—
②デリバティブ取引	2,930,815	2,930,815	—
(4)営業貸付金	1,564,856		
貸倒引当金	△53		
	1,564,803	1,565,714	911
(5)信用取引資産			
信用取引貸付金	157,309	157,309	—
信用取引借証券担保金	17,724	17,724	—
(6)有価証券担保貸付金			
借入有価証券担保金	5,119,636	5,119,636	—
現先取引貸付金	854,135	854,135	—
(7)有価証券、営業投資有価証券及び投資有価証券			
①売買目的有価証券	—	—	—
②満期保有目的の債券	132,124	133,964	1,840
③子会社株式及び関連会社株式	122,584		
投資損失引当金	—		
	122,584	184,422	61,837
④その他有価証券	854,484	854,484	—
資産計	20,016,700	20,081,290	64,589
負債			
(1)トレーディング商品			
①商品有価証券等	2,040,196	2,040,196	—
②デリバティブ取引	2,707,580	2,707,580	—
(2)約定見返勘定	255,804	255,804	—
(3)信用取引負債			
信用取引借入金	3,675	3,675	—
信用取引貸証券受入金	66,306	66,306	—
(4)有価証券担保借入金			
有価証券貸借取引受入金	4,934,115	4,934,115	—
現先取引借入金	1,013,853	1,013,853	—
(5)銀行業における預金	3,632,575	3,632,409	165
(6)預り金	276,700	276,700	—
(7)受入保証金	372,591	372,591	—
(8)短期借入金	1,341,415	1,341,415	—
(9)コマーシャル・ペーパー	100,000	100,000	—
(10)1年内償還予定の社債	190,772	190,772	—
(11)社債	1,361,918	1,367,467	△5,548
(12)長期借入金	1,336,787	1,338,147	△1,359
負債計	19,634,294	19,641,037	△6,742
トレーディングに係るもの以外のデリバティブ取引(※)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	△3,500	△3,500	—
ヘッジ会計が適用されているもの	△6,813	△8,308	△1,494
トレーディングに係るもの以外のデリバティブ取引計	△10,314	△11,808	△1,494

※トレーディングに係るもの以外のデリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、△で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

(ア) 現金・預金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(イ) 預託金

主に顧客分別金信託で構成され、国債等の有価証券投資を行っているものについては類似の債券を含めた直前の取引値段から計算される各期間に応じた指標金利との利回り格差を用いて合理的に算出する価格に基づいて算定しております。その他運用商品については、短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(ウ) トレーディング商品

① 商品有価証券等

株式等	主たる取引所の最終価格又は最終気配値
債券	主に類似の債券を含めた直前の取引値段(当社店頭、ブローカーズスクリーン等)や市場価格情報(売買参考統計値等)から、指標金利との格差等を用いて、合理的に算定される価格
受益証券	取引所の最終価格若しくは最終気配値又は基準価額

② デリバティブ取引

取引所取引のデリバティブ取引	主に取引所の清算値段又は証拠金算定基準値段
金利スワップ取引等	イールドカーブより算出される予想キャッシュ・フロー、原債券の価格・クーポンレート、金利、ディスカウントレート、ボラティリティ、コリレーション等を基に、価格算定モデル(市場で一般に認識されているモデル若しくはこれらを拡張したモデル)により算出した価格
店頭エクイティ・デリバティブ取引	株価又は株価指数、金利、配当、ボラティリティ、ディスカウントレート、コリレーション等を用いて、価格算定モデル(市場で一般に認識されているモデル若しくはこれらを拡張したモデル)により算出した価格
クレジット・デリバティブ取引	金利、参照先の信用スプレッド等を用いて、価格算定モデル(市場で一般に認識されているモデル若しくはこれらを拡張したモデル)により算出した価格

なお、店頭デリバティブ取引については、取引相手先の信用リスク相当額及び流動性リスク相当額を必要に応じて時価に追加しております。

(エ) 約定見返勘定

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(オ) 営業貸付金

主に銀行業における貸出金や顧客から保護預かりしている有価証券を担保として金銭を貸付する証券担保ローンであります。

銀行業における貸出金のうち、変動金利によるものは、短期間で市場金利を反映するため、貸出先の信用状態が実行後大きく異ならない限り、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。また、固定金利によるものは、貸出金の種類及び期間等に基づき、元利金の合計額を同様の新規貸付を行った場合に想定される利率で割り引いて時価を算定しております。

証券担保ローンについては、返済見込期間及び金利条件等から、時価は帳簿価額と近似しているものと想定されるため、帳簿価額を時価としております。

(カ) 信用取引資産、信用取引負債

信用取引資産は顧客の信用取引に伴う顧客への貸付金と証券金融会社への担保金であり、前者は顧客の意思による反対売買等により決済が行われ、後者は貸借取引業務において値洗いされる担保金であることから、短期間で決済されるとみなして帳簿価額を時価としております。

信用取引負債は顧客の信用取引に伴う証券金融会社からの借入金と顧客の信用取引に係る有価証券の売付代金相当額であり、前者は値洗いされ、後者は顧客の意思による反対売買等により決済が行われることから、短期間で決済されるとみなして帳簿価額を時価としております。

(キ) 有価証券担保貸付金、有価証券担保借入金

これらは、そのほとんどが短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

(ア) 現金・預金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(イ) 預託金

主に顧客分別金信託で構成され、国債等の有価証券投資を行っているものについては類似の債券を含めた直前の取引値段から計算される各期間に応じた指標金利との利回り格差を用いて合理的に算出する価格に基づいて算定しております。その他運用商品については、短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(ウ) トレーディング商品

① 商品有価証券等

株式等	主たる取引所の最終価格又は最終気配値
債券	主に類似の債券を含めた直前の取引値段(当社店頭、ブローカーズスクリーン等)や市場価格情報(売買参考統計値等)から、指標金利との格差等を用いて、合理的に算定される価格
受益証券	取引所の最終価格若しくは最終気配値又は基準価額

② デリバティブ取引

取引所取引のデリバティブ取引	主に取引所の清算値段又は証拠金算定基準値段
金利スワップ取引等	イールドカーブより算出される予想キャッシュ・フロー、原債券の価格・クーポンレート、金利、ディスカウントレート、ボラティリティ、コリレーション等を基に、価格算定モデル(市場で一般に認識されているモデル若しくはこれらを拡張したモデル)により算出した価格
店頭エクイティ・デリバティブ取引	株価又は株価指数、金利、配当、ボラティリティ、ディスカウントレート、コリレーション等を用いて、価格算定モデル(市場で一般に認識されているモデル若しくはこれらを拡張したモデル)により算出した価格
クレジット・デリバティブ取引	金利、参照先の信用スプレッド等を用いて、価格算定モデル(市場で一般に認識されているモデル若しくはこれらを拡張したモデル)により算出した価格

なお、店頭デリバティブ取引については、取引相手先の信用リスク相当額及び流動性リスク相当額を必要に応じて時価に追加しております。

(エ) 約定見返勘定

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(オ) 営業貸付金

主に銀行業における貸出金や顧客から保護預かりしている有価証券を担保として金銭を貸付する証券担保ローンであります。

銀行業における貸出金のうち、変動金利によるものは、短期間で市場金利を反映するため、貸出先の信用状態が実行後大きく異ならない限り、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。また、固定金利によるものは、貸出金の種類及び期間等に基づき、元利金の合計額を同様の新規貸付を行った場合に想定される利率で割り引いて時価を算定しております。

証券担保ローンについては、返済見込期間及び金利条件等から、時価は帳簿価額と近似しているものと想定されるため、帳簿価額を時価としております。

(カ) 信用取引資産、信用取引負債

信用取引資産は顧客の信用取引に伴う顧客への貸付金と証券金融会社への担保金であり、前者は顧客の意思による反対売買等により決済が行われ、後者は貸借取引業務において値洗いされる担保金であることから、短期間で決済されるとみなして帳簿価額を時価としております。

信用取引負債は顧客の信用取引に伴う証券金融会社からの借入金と顧客の信用取引に係る有価証券の売付代金相当額であり、前者は値洗いされ、後者は顧客の意思による反対売買等により決済が行われることから、短期間で決済されるとみなして帳簿価額を時価としております。

(キ) 有価証券担保貸付金、有価証券担保借入金

これらは、そのほとんどが短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(ク)有価証券、営業投資有価証券及び投資有価証券

株式等	主たる取引所の最終価格又は最終気配値
債券	主に類似の債券を含めた直前の取引値段(当社店頭、ブローカースクリーン等)や市場価格情報(売買参考統計値等)から、指標金利との格差等を用いて、合理的に算定される価格、又は裏付資産の価値から合理的に算定される価格
受益証券	取引所の最終価格若しくは最終気配値又は基準価額
組合出資金	組合出資金のうち、不動産による回収見込額等に基づき投資損失引当金を算定しているものについては、時価は連結決算日における貸借対照表価額から現在の投資損失引当金を控除した金額に近似しており、当該金額をもって時価としている

(ケ)銀行業における預金

預金のうち、要求払預金については、決算日に要求された場合の支払額(帳簿価額)を時価とみなしております。

また、定期預金の時価は、将来のキャッシュ・フローを見積り、一定の割引率で割り引いて時価を算定しております。

割引率は当社の信用スプレッドを加味したイールドカーブから算出しております。

(コ)預り金

主として顧客から受入れている預り金であり、当連結会計年度末に決済された場合の支払額(帳簿価額)を時価とみなしております。その他の預り金については短期間に支払いが行われるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(カ)受入保証金

主としてデリバティブ取引における保証金であり、取引に応じて値洗いされる特性から、短期間で決済されるとみなして帳簿価額を時価としております。その他の顧客からの保証金については、当連結会計年度末に決済された場合の支払額(帳簿価額)を時価とみなしております。

(キ)短期借入金、コマーシャル・ペーパー、1年内償還予定の社債

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(ク)社債

償還まで1年超の社債の時価について、市場価格(売買参考統計値等)が入手可能な場合には、その時価を市場価格から算定しております。市場価格が入手不可能な場合は、発行時からの金利変動及び当社自身の信用スプレッドの変動相当額を、帳簿価額に調整することによって算定しております。当社自身の信用スプレッドについては、直近の調達レート、自社発行の類似債券の市場価格水準等を参照しております。

(ケ)長期借入金

借入当初からの金利変動及び信用スプレッドの変動相当額を、帳簿価額に調整することによって算定しております。当社自身の信用スプレッドについては、直近の調達レート、自社発行の類似債券の市場価格水準等を参照しております。

(コ)トレーディングに係るもの以外のデリバティブ取引

〔(ウ)トレーディング商品②デリバティブ取引〕と同様となっております。

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品は次のとおりであり、資産(7)「③子会社株式及び関連会社株式」及び「④その他有価証券」には含まれておりません。

(単位：百万円)

区分	連結貸借対照表計上額
子会社株式及び関連会社株式	
非上場株式	37,301
その他有価証券	
非上場株式	33,702
投資事業有限責任組合及びそれに類する組合等への出資	70,151
その他	5,361

(注)市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから時価開示の対象とはしておりません。

(ク)有価証券、営業投資有価証券及び投資有価証券

株式等	主たる取引所の最終価格又は最終気配値
債券	主に類似の債券を含めた直前の取引値段(当社店頭、ブローカースクリーン等)や市場価格情報(売買参考統計値等)から、指標金利との格差等を用いて、合理的に算定される価格、又は裏付資産の価値から合理的に算定される価格
受益証券	取引所の最終価格若しくは最終気配値又は基準価額
組合出資金	組合出資金のうち、不動産による回収見込額等に基づき投資損失引当金を算定しているものについては、時価は連結決算日における貸借対照表価額から現在の投資損失引当金を控除した金額に近似しており、当該金額をもって時価としている

(ケ)銀行業における預金

預金のうち、要求払預金については、決算日に要求された場合の支払額(帳簿価額)を時価とみなしております。

また、定期預金の時価は、将来のキャッシュ・フローを見積り、一定の割引率で割り引いて時価を算定しております。

割引率は当社の信用スプレッドを加味したイールドカーブから算出しております。

(コ)預り金

主として顧客から受入れている預り金であり、当連結会計年度末に決済された場合の支払額(帳簿価額)を時価とみなしております。その他の預り金については短期間に支払いが行われるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(カ)受入保証金

主としてデリバティブ取引における保証金であり、取引に応じて値洗いされる特性から、短期間で決済されるとみなして帳簿価額を時価としております。その他の顧客からの保証金については、当連結会計年度末に決済された場合の支払額(帳簿価額)を時価とみなしております。

(キ)短期借入金、コマーシャル・ペーパー、1年内償還予定の社債

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(ク)社債

償還まで1年超の社債の時価について、市場価格(売買参考統計値等)が入手可能な場合には、その時価を市場価格から算定しております。市場価格が入手不可能な場合は、発行時からの金利変動及び当社自身の信用スプレッドの変動相当額を、帳簿価額に調整することによって算定しております。当社自身の信用スプレッドについては、直近の調達レート、自社発行の類似債券の市場価格水準等を参照しております。

(ケ)長期借入金

借入当初からの金利変動及び信用スプレッドの変動相当額を、帳簿価額に調整することによって算定しております。当社自身の信用スプレッドについては、直近の調達レート、自社発行の類似債券の市場価格水準等を参照しております。

(コ)トレーディングに係るもの以外のデリバティブ取引

〔(ウ)トレーディング商品②デリバティブ取引〕と同様となっております。

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品は次のとおりであり、資産(7)「③子会社株式及び関連会社株式」及び「④その他有価証券」には含まれておりません。

(単位：百万円)

区分	連結貸借対照表計上額
子会社株式及び関連会社株式	
非上場株式	46,618
その他有価証券	
非上場株式	33,138
投資事業有限責任組合及びそれに類する組合等への出資	103,934
その他	3,974

(注)市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから時価開示の対象とはしておりません。

2018年3月期

2019年3月期

賃貸等不動産に関する注記

1. 賃貸等不動産の状況に関する事項

当社グループは、東京都に再開発事業用地等を有しております。

2. 賃貸等不動産の時価に関する事項

当連結会計年度末における連結貸借対照表計上額及び時価は、次のとおりであります。

(単位：百万円)

連結貸借対照表計上額	時価
5,293	—

(注) 再開発中の資産は、大規模な複合再開発などの開発段階にあり、時価を把握することが極めて困難であるため、記載しておりません。

1. 賃貸等不動産の状況に関する事項

当社グループは、東京都に再開発事業用地等を有しております。

2. 賃貸等不動産の時価に関する事項

当連結会計年度末における連結貸借対照表計上額及び時価は、次のとおりであります。

(単位：百万円)

連結貸借対照表計上額	時価
31,544	—

(注) 再開発中の資産は、大規模な複合再開発などの開発段階にあり、時価を把握することが極めて困難であるため、記載しておりません。

1株当たり情報に関する注記

1株当たり純資産額	786円56銭
1株当たり当期純利益	66円88銭

1株当たり純資産額	794円54銭
1株当たり当期純利益	39円95銭

重要な後発事象

該当事項はありません。

(持分法適用関連会社の合併)

当社の持分法適用関連会社である大和住銀投信投資顧問株式会社(以下「大和住銀」)は、2019年4月1日に三井住友アセットマネジメント株式会社(以下「SMAM」)とSMAMを存続会社、大和住銀を消滅会社とする吸収合併を行いました。合併後企業の名称は三井住友DSアセットマネジメント株式会社となります。

本合併に伴い、持分変動損益が発生する見込みですが、影響額については現在算定中であります。

借入金の主要な借入先及び借入金額

借入先	借入金の種類	借入金残高
株式会社三井住友銀行	長期借入金	171,248百万円
	短期借入金	42,496百万円
株式会社みずほ銀行	長期借入金	113,248百万円
	短期借入金	83,574百万円
株式会社三菱東京UFJ銀行	長期借入金	13,000百万円
	短期借入金	20,000百万円
株式会社りそな銀行	短期借入金	3,000百万円
	長期借入金	22,240百万円
株式会社山口銀行	短期借入金	10,000百万円
	長期借入金	10,000百万円

(注1) 当社グループ外からの借入のうち、コールマネー等を除く主要なものを記載しております。

(注2) 株式会社三菱東京UFJ銀行は、2018年4月1日に銀行名を株式会社三菱UFJ銀行に変更いたしました。

借入先	借入金の種類	借入金残高
株式会社三井住友銀行	短期借入金	30,000百万円
	長期借入金	142,198百万円
株式会社みずほ銀行	短期借入金	54,396百万円
	長期借入金	104,198百万円
株式会社三菱UFJ銀行	短期借入金	23,814百万円
	長期借入金	60,644百万円
株式会社りそな銀行	長期借入金	33,000百万円
株式会社山口銀行	短期借入金	5,549百万円
	長期借入金	21,928百万円

(注) 当社グループ外からの借入のうち、コールマネー等を除く主要なものを記載しております。

保有する有価証券(トレーディング商品に属するものとして経理された有価証券を除く)の取得価額、時価及び評価損益

(1) 満期保有目的の債券

(単位：百万円)

種類	連結貸借対照表計上額	時価	差額
時価が連結貸借対照表計上額を超えるもの	100,746	101,168	422
国債・地方債等	9	10	0
社債	100,736	101,158	422
その他	—	—	—
時価が連結貸借対照表計上額を超えないもの	10,798	10,792	△6
国債・地方債等	—	—	—
社債	10,798	10,792	△6
その他	—	—	—

(1) 満期保有目的の債券

(単位：百万円)

種類	連結貸借対照表計上額	時価	差額
時価が連結貸借対照表計上額を超えるもの	127,424	129,265	1,841
国債・地方債等	—	—	—
社債	127,424	129,265	1,841
その他	—	—	—
時価が連結貸借対照表計上額を超えないもの	4,700	4,699	△0
国債・地方債等	—	—	—
社債	4,700	4,699	△0
その他	—	—	—

2018年3月期

(2) その他有価証券

(単位：百万円)

種類	連結貸借 対照表計上額	取得原価又は 償却原価	差額
連結貸借対照表計上額が取得原 価又は償却原価を超えるもの	692,917	597,967	94,950
株券	139,579	63,157	76,421
債券	338,075	332,656	5,418
国債・地方債等	10,417	10,052	364
社債	67,153	64,564	2,588
その他	260,505	258,039	2,465
投資事業有限責任組合及びそ れに類する組合等への出資	—	—	—
その他	215,263	202,153	13,110
連結貸借対照表計上額が取得 原価又は償却原価を超えない もの	390,027	401,343	△11,315
株券	33,935	40,070	△6,134
債券	259,981	262,533	△2,551
国債・地方債等	28,284	28,309	△24
社債	54,343	54,399	△55
その他	177,353	179,824	△2,471
投資事業有限責任組合及びそ れに類する組合等への出資	28,157	28,157	—
その他	67,953	70,582	△2,629

(注1) 時価を把握することが極めて困難と認められるものについては、上表には含めておりません。(金融商品関係) 2 金融商品の時価等に関する事項(注2)に記載のとおりであります。

(注2) 投資事業有限責任組合及びそれに類する組合等への出資には、子会社等に該当する投資事業有限責任組合等への出資が28,157百万円含まれております。

2019年3月期

(2) その他有価証券

(単位：百万円)

種類	連結貸借 対照表計上額	取得原価又は 償却原価	差額
連結貸借対照表計上額が取得原 価又は償却原価を超えるもの	644,523	567,680	76,842
株券	105,904	50,026	55,878
債券	387,792	376,615	11,176
国債・地方債等	95,974	92,388	3,585
社債	54,783	52,262	2,521
その他	237,034	231,965	5,069
投資事業有限責任組合及びそ れに類する組合等への出資	—	—	—
その他	150,825	141,038	9,787
連結貸借対照表計上額が取得 原価又は償却原価を超えない もの	209,961	220,365	△10,403
株券	26,748	32,743	△5,995
債券	79,823	80,147	△324
国債・地方債等	—	—	—
社債	8,199	8,200	△0
その他	71,623	71,947	△323
投資事業有限責任組合及びそ れに類する組合等への出資	28,599	28,599	—
その他	74,790	78,873	△4,083

(注1) 時価を把握することが極めて困難と認められるものについては、上表には含めておりません。(金融商品関係) 2 金融商品の時価等に関する事項(注2)に記載のとおりであります。

(注2) 投資事業有限責任組合及びそれに類する組合等への出資には、子会社等に該当する投資事業有限責任組合等への出資が28,599百万円含まれております。

デリバティブ取引(トレーディング商品に属するものとして経理された取引を除く)の契約価額、時価及び評価損益

(1) ヘッジ会計が適用されていないもの

契約額又は契約において定められた元本相当額、時価及び評価損益は次のとおりであります。

(単位：百万円)

種類	契約額等	時価	評価損益
為替予約取引	113,493	△881	△881
クレジット・デリバティブ取引	10,000	△262	△262
株価指数先物取引	11,090	△118	△118
金利スワップ取引	10,198	△355	△355
通貨スワップ取引	124,689	643	643

(注) 時価の算定方法については、「(金融商品関係) 2 金融商品の時価等に関する事項(注1) 金融商品の時価の算定方法 (ウ) トレーディング商品 ② デリバティブ取引」に記載のとおりであります。

(2) ヘッジ会計が適用されているもの

主なヘッジ対象、契約額又は契約において定められた元本相当額及び時価は次のとおりであります。

(単位：百万円)

種類	ヘッジ会計の方法	主なヘッジ対象	契約額等	時価
為替予約取引	原則的処理方法(注)	外貨建の貸出金、有価証券、預金	373,942	3,371
株式先渡取引	原則的処理方法	株式	19,170	1,998
金利スワップ取引	原則的処理方法	借入金及び有価証券	259,327	△222
通貨スワップ取引	為替予約等の振当処理	借入金	29,747	△3,447
	原則的処理方法(注)	外貨建の貸出金、有価証券	194,235	386
金利通貨スワップ取引	金利通貨スワップの一体処理(特例処理・振当処理)	社債	5,630	333

(注) 銀行業を行う子会社において、業種別監査委員会報告第25号に基づき、繰延ヘッジによっております。

(1) ヘッジ会計が適用されていないもの

契約額又は契約において定められた元本相当額、時価及び評価損益は次のとおりであります。

(単位：百万円)

種類	契約額等	時価	評価損益
為替予約取引	102,872	△2,208	△2,208
クレジット・デリバティブ取引	60,000	△407	△407
金利スワップ取引	10,375	△414	△414
通貨スワップ取引	180,867	△470	△470

(注) 時価の算定方法については、「(金融商品関係) 2 金融商品の時価等に関する事項(注1) 金融商品の時価の算定方法 (ウ) トレーディング商品 ② デリバティブ取引」に記載のとおりであります。

(2) ヘッジ会計が適用されているもの

主なヘッジ対象、契約額又は契約において定められた元本相当額及び時価は次のとおりであります。

(単位：百万円)

種類	ヘッジ会計の方法	主なヘッジ対象	契約額等	時価
為替予約取引	原則的処理方法(注)	外貨建の貸出金、有価証券、預金	202,754	4,175
金利スワップ取引	原則的処理方法	借入金及び有価証券	295,407	△9,234
通貨スワップ取引	為替予約等の振当処理	借入金	33,300	△2,115
	原則的処理方法(注)	外貨建の貸出金、有価証券	196,828	△1,754
金利通貨スワップ取引	金利通貨スワップの一体処理(特例処理・振当処理)	社債	5,289	621

(注) 銀行業を行う子会社において、業種別監査委員会報告第25号に基づき、繰延ヘッジによっております。

2018年3月期

2019年3月期

財務諸表に関する監査法人等による監査の有無

当社は、会社法第444条第4項の規定に基づき、連結計算書類について有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

当社は、会社法第444条第4項の規定に基づき、連結計算書類について有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

経営の健全性の状況

主要な指標

【KM1】

(単位 百万円, %)

国際様式の 該当番号		2019年3月末	2018年12月末	2018年9月末	2018年6月末	2018年3月末
資本						
1	普通株式等Tier1資本の額	1,092,835	1,085,262	1,111,476	1,134,950	1,142,340
2	Tier1資本の額	1,092,835	1,085,262	1,111,476	1,134,950	1,142,340
3	総自己資本の額	1,092,835	1,085,262	1,111,476	1,134,950	1,142,340
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	4,953,208	4,911,966	5,234,732	4,989,109	5,125,879
自己資本比率						
5	連結普通株式等Tier1比率	22.06%	22.09%	21.23%	22.74%	22.28%
6	連結Tier1比率	22.06%	22.09%	21.23%	22.74%	22.28%
7	連結総自己資本比率	22.06%	22.09%	21.23%	22.74%	22.28%
資本バッファ						
8	資本保全バッファ比率	2.50%	1.87%	1.87%	1.87%	1.87%
9	カウンター・シクリカル・バッファ比率	0.02%	0.02%	0.01%	0.01%	0.00%
10	G-SIB/D-SIBバッファ比率	0.50%	0.37%	0.37%	0.37%	0.37%
11	最低連結資本バッファ比率	3.02%	2.27%	2.26%	2.26%	2.25%
12	連結資本バッファ比率	14.06%	14.09%	13.23%	14.74%	14.28%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	19,067,611	20,199,002	19,458,472	19,902,398	20,358,038
14	連結レバレッジ比率	5.73%	5.37%	5.71%	5.70%	5.61%

2018年3月末

自己資本の構成に関する開示事項

(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	経過措置に よる不算入額
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	1,185,256	
1a	うち、資本金及び資本剰余金の額	478,111	
2	うち、利益剰余金の額	785,730	
1c	うち、自己株式の額(△)	54,306	
26	うち、社外流出予定額(△)	24,279	
	うち、上記以外に該当するものの額	-	
1b	普通株式に係る新株予約権の額	8,790	
3	その他の包括利益累計額及びその他公表準備金の額	63,597	-
5	普通株式等Tier1資本に係る調整後非支配株主持分の額	-	
	経過措置により普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の 額に算入されるものの額の合計額	-	
	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)	1,257,644	
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・ライセンスに係るものを除く。)の額の合計額	105,776	-
8	うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	11,170	-
9	うち、のれん及びモーゲージ・サービシング・ライセンスに係るもの以外のものの額	94,605	-
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	580	-
11	繰延ヘッジ損益の額	△127	-
12	適格引当金不足額	-	-
13	証券化取引に伴い増加した自己資本に相当する額	-	-
14	負債の時価評価により生じた時価評価差額であって自己資本に算入される額	-	-
15	退職給付に係る資産の額	-	-
16	自己保有普通株式(純資産の部に計上されるものを除く。)の額	428	-
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	4,629	-
19+20+21	特定項目に係る十パーセント基準超過額	-	-
19	うち、その他金融機関等に係る対象資本調達手段のうち普通株式に該当するものに関するものの額	-	-
20	うち、無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライセンスに係るものに限る。)に関するものの額	-	-
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調達手段のうち普通株式に該当するものに関するものの額	-	-
24	うち、無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライセンスに係るものに限る。)に関するものの額	-	-
25	うち、繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に関するものの額	-	-
27	その他Tier1資本不足額	4,016	-
28	普通株式等Tier1資本に係る調整項目の額 (ロ)	115,303	
普通株式等Tier1資本			
29	普通株式等Tier1資本の額((イ)-(ロ)) (ハ)	1,142,340	
その他Tier1資本に係る基礎項目 (3)			
30	31a その他Tier1資本調達手段に係る株主資本の額及びその内訳	-	
	31b その他Tier1資本調達手段に係る新株予約権の額	-	
	32 その他Tier1資本調達手段に係る負債の額	-	
	特別目的会社等の発行するその他Tier1資本調達手段の額	-	
34-35	その他Tier1資本に係る調整後非支配株主持分の額	-	
33+35	適格旧Tier1資本調達手段の額のうちその他Tier1資本に係る基礎項目の額に含まれる額	-	
33	うち、最終指定親会社及び最終指定親会社の特別目的会社等の発行する資本調達手段の額	-	
	うち、最終指定親会社の連結子法人等(最終指定親会社の特別目的会社等を除く。)の発行する資本調達手段の額	-	
35	経過措置によりその他Tier1資本に係る基礎項目の額に算入されるものの額の合計額	-	
	外国為替換算調整	-	
36	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 (ニ)	-	

2019年3月末

自己資本の構成に関する開示事項

(単位 百万円、%)

CC1：自己資本の構成			
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	1,182,379	
1a	うち、資本金及び資本剰余金の額	478,030	(i),(j)
2	うち、利益剰余金の額	805,761	(k)
1c	うち、自己株式の額(△)	87,315	(l),(m)
26	うち、社外流出予定額(△)	14,096	
	うち、上記以外に該当するものの額	-	
1b	普通株式に係る新株予約権の額	8,741	(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	48,000	(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)	1,239,122	
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・ライセンスに係るものを除く。)の額の合計額	115,937	
8	うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	10,605	(e)
9	うち、のれん及びモーゲージ・サービシング・ライセンスに係るもの以外のものの額	105,331	(f)
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	382	(d),(h)
11	繰延ヘッジ損益の額	△141	(n)
12	適格引当金不足額	-	-
13	証券化取引に伴い増加した自己資本に相当する額	-	-
14	負債の時価評価により生じた時価評価差額であって自己資本に算入される額	-	-
15	退職給付に係る資産の額	-	-
16	自己保有普通株式(純資産の部に計上されるものを除く。)の額	196	(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	11,653	(a),(b),(c),(g)
19+20+21	特定項目に係る十パーセント基準超過額	-	-
19	うち、その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に該当するものに関するものの額	-	-
20	うち、無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライセンスに係るものに限る。)に関するものの額	-	-
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・ライセンスに係るものに限る。)に関するものの額	-	-
25	うち、繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に関するものの額	-	-
27	その他Tier1資本不足額	18,258	
28	普通株式等Tier1資本に係る調整項目の額 (ロ)	146,287	
普通株式等Tier1資本			
29	普通株式等Tier1資本の額((イ)-(ロ)) (ハ)	1,092,835	
その他Tier1資本に係る基礎項目 (3)			
30	31a その他Tier1資本調達手段に係る株主資本の額及びその内訳	-	
	31b その他Tier1資本調達手段に係る新株予約権の額	-	
	32 その他Tier1資本調達手段に係る負債の額	-	
	特別目的会社等の発行するその他Tier1資本調達手段の額	-	
34-35	その他Tier1資本に係る調整後非支配株主持分の額	-	(q)
33+35	適格旧Tier1資本調達手段の額のうちその他Tier1資本に係る基礎項目の額に含まれる額	-	
33	うち、最終指定親会社及び最終指定親会社の特別目的会社等の発行する資本調達手段の額	-	
35	うち、最終指定親会社の連結子法人等(最終指定親会社の特別目的会社等を除く。)の発行する資本調達手段の額	-	
36	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 (ニ)	-	

2018年3月末

(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	経過措置に よる不算入額
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	769	-
40	その他金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額	-	-
	経過措置によりその他Tier1資本に係る調整項目の額に算入されるものの額の合計額	-	-
	のれん	-	-
42	Tier2資本不足額	3,246	-
43	その他Tier1資本に係る調整項目の額 (ホ)	4,016	-
その他Tier1資本			
44	その他Tier1資本の額((二)-(ホ)) (ヘ)	-	-
Tier1資本			
45	Tier1資本の額((ハ)+(ヘ)) (ト)	1,142,340	-
Tier2資本に係る基礎項目 (4)			
46	Tier2資本調達手段に係る株主資本の額及びその内訳	-	-
	Tier2資本調達手段に係る新株予約権の額	-	-
	Tier2資本調達手段に係る負債の額	-	-
	特別目的会社等の発行するTier2資本調達手段の額	-	-
48-49	Tier2資本に係る調整後非支配株主持分等の額	-	-
47+49	適格旧Tier2資本調達手段の額のうちTier2資本に係る基礎項目の額に含まれる額	-	-
47	うち、最終指定親会社及び最終指定親会社の特別目的会社等の発行する資本調達手段の額	-	-
	うち、最終指定親会社の連結子法人等(最終指定親会社の特別目的会社等を除く。)の発行する資本調達手段の額	-	-
49	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	-	-
	経過措置によりTier2資本に係る基礎項目の額に算入されるものの額の合計額	-	-
	資本調達手段に係る額	-	-
	その他有価証券評価差額金及び繰延ヘッジ損益	-	-
51	Tier2資本に係る基礎項目の額 (チ)	-	-
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外部TLAC関連調達手段の額	14,025	(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)	14,025	-
Tier2資本			
58	Tier2資本の額((チ)-(リ)) (ヌ)	-	-
総自己資本			
59	総自己資本の額((ト)+(ヌ)) (ル)	1,142,340	-
リスク・アセット (5)			
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額の合計額	-	-
	少数出資金融機関等の資本調達手段	-	-
	無形固定資産(のれんを除く。)	-	-
	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)	-	-
60	リスク・アセットの額の合計額 (ヲ)	5,125,879	-
連結自己資本規制比率			
61	連結普通株式等Tier1比率((ハ)/(ヲ))	22.28%	-
62	連結Tier1比率((ト)/(ヲ))	22.28%	-
63	連結総自己資本規制比率((ル)/(ヲ))	22.28%	-
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調達手段に係る調整項目不算入額	115,098	-
73	その他金融機関等に係る対象資本調達手段のうち普通株式に係る調整項目不算入額	33,651	-
74	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライセンスに係るものに限る。)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	12,283	-

2019年3月末

(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	4,233	(a),(b),(c),(g)
40	その他金融機関等のその他Tier1資本調達手段の額	-	-
42	Tier2資本不足額	14,025	-
43	その他Tier1資本に係る調整項目の額 (ホ)	18,258	-
その他Tier1資本			
44	その他Tier1資本の額((二)-(ホ)) (ヘ)	-	-
Tier1資本			
45	Tier1資本の額((ハ)+(ヘ)) (ト)	1,092,835	-
Tier2資本に係る基礎項目 (4)			
46	Tier2資本調達手段に係る株主資本の額及びその内訳	-	-
	Tier2資本調達手段に係る新株予約権の額	-	-
	Tier2資本調達手段に係る負債の額	-	-
	特別目的会社等の発行するTier2資本調達手段の額	-	-
48-49	Tier2資本に係る調整後非支配株主持分等の額	-	(q)
47+49	適格旧Tier2資本調達手段の額のうちTier2資本に係る基礎項目の額に含まれる額	-	-
47	うち、最終指定親会社及び最終指定親会社の特別目的会社等の発行する資本調達手段の額	-	-
	うち、最終指定親会社の連結子法人等(最終指定親会社の特別目的会社等を除く。)の発行する資本調達手段の額	-	-
49	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)	-	-
Tier2資本に係る調整項目 (5)			
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外部TLAC関連調達手段の額	14,025	(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)	14,025	-
Tier2資本			
58	Tier2資本の額((チ)-(リ)) (ヌ)	-	-
総自己資本			
59	総自己資本の額((ト)+(ヌ)) (ル)	1,092,835	-
リスク・アセット (6)			
60	リスク・アセットの額の合計額 (ヲ)	4,953,208	-
連結自己資本規制比率 (7)			
61	連結普通株式等Tier1比率((ハ)/(ヲ))	22.06%	-
62	連結Tier1比率((ト)/(ヲ))	22.06%	-
63	連結総自己資本規制比率((ル)/(ヲ))	22.06%	-
64	最低連結資本バッファ率	3.02%	-
65	うち、資本保全バッファ率	2.50%	-
66	うち、カウンター・シクリカル・バッファ率	0.02%	-
67	うち、G-SIB/D-SIB/バッファ率	0.50%	-
68	連結資本バッファ率	14.06%	-
調整項目に係る参考事項 (8)			
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	112,274	(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	43,961	(a),(b),(c),(g)
74	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライセンスに係るものに限る。)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	6,533	(d),(h)

2018年3月末

(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	経過措置に よる不算入額
Tier2資本に係る基礎項目の額に算入される引当金に関する事項 (7)			
76	一般貸倒引当金の額	-	
77	一般貸倒引当金に係るTier2資本算入上限額	-	
78	内部格付手法採用最終指定親会社において、適格引当金の合計額から事業法人等向けエクスポージャー及びリテール向けエクスポージャーの期待損失額の合計額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-	
79	適格引当金に係るTier2資本算入上限額	-	
資本調達手段に係る経過措置に関する事項 (8)			
82	適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額	-	
83	適格旧Tier1資本調達手段の額から適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-	
84	適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額	-	
85	適格旧Tier2資本調達手段の額から適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-	

2019年3月末

(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資本に係る基礎項目の額に算入される引当金に関する事項 (9)			
76	一般貸倒引当金の額	-	
77	一般貸倒引当金に係るTier2資本算入上限額	-	
78	内部格付手法採用最終指定親会社において、適格引当金の合計額から事業法人等向けエクスポージャー及びリテール向けエクスポージャーの期待損失額の合計額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-	
79	適格引当金に係るTier2資本算入上限額	-	
資本調達手段に係る経過措置に関する事項 (10)			
82	適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額	-	
83	適格旧Tier1資本調達手段の額から適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-	
84	適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額	-	
85	適格旧Tier2資本調達手段の額から適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-	

定性的な開示事項

1. 連結の範囲に関する事項

- イ 連結自己資本規制比率告示第3条の規定により連結自己資本規制比率を算出する対象となる会社の集団（会社グループ）に属する会社と連結財務諸表提出会社として作成された連結財務諸表における連結の範囲（会計連結範囲）に含まれる会社との相違点及び当該相違点の生じた原因
相違点はありません。

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

連結子会社の数		59社	
主要な連結子会社の名称	主要な業務の内容		
大和証券株式会社	有価証券関連業、投資助言・代理業		
大和証券投資信託委託株式会社	投資運用業、投資助言・代理業		
株式会社大和総研ホールディングス	子会社の統合・管理		
株式会社大和証券ビジネスセンター	事務代行業		
大和プロパティ株式会社	不動産賃貸業		
株式会社大和ネクスト銀行	銀行業		
株式会社大和総研	情報サービス業		
株式会社大和総研ビジネス・イノベーション	情報サービス業		
株式会社大和キャピタル・ホールディングス	子会社の統合・管理		
大和企業投資株式会社	投資業		
大和P1パートナーズ株式会社	投資業		
大和証券エスエムビーシープリンシパル・インベストメンツ株式会社	投資業		
大和リアル・エステート・アセット・マネジメント株式会社	投資運用業、投資助言・代理業		
大和証券キャピタル・マーケッ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の名称、貸借対照表の総資産の額及び純資産の額並びに主要な業務の内容
該当ありません。

- ホ 会社グループ内の資金及び自己資本の移動に係る制限等の概要
グループ内の資金及び自己資本の移動に係る特別な制限等はありません。

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及び規制資本により評価しております。

（経済資本）

当社グループでは、リスクアパタイト・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リスク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。

定性的な開示事項

1. 連結の範囲に関する事項

- イ 連結自己資本規制比率告示第3条の規定により連結自己資本規制比率を算出する対象となる会社の集団（会社グループ）に属する会社と連結財務諸表提出会社として作成された連結財務諸表における連結の範囲（会計連結範囲）に含まれる会社との相違点及び当該相違点の生じた原因
相違点はありません。

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

連結子会社の数		60社	
主要な連結子会社の名称	主要な業務の内容		
大和証券株式会社	有価証券関連業、投資助言・代理業		
大和証券投資信託委託株式会社	投資運用業、投資助言・代理業		
株式会社大和総研ホールディングス	子会社の統合・管理		
株式会社大和証券ビジネスセンター	事務代行業		
大和プロパティ株式会社	不動産賃貸業		
株式会社大和ネクスト銀行	銀行業		
株式会社大和総研	情報サービス業		
株式会社大和総研ビジネス・イノベーション	情報サービス業		
大和企業投資株式会社	投資業		
大和P1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の名称、貸借対照表の総資産の額及び純資産の額並びに主要な業務の内容
該当ありません。

- ホ 会社グループ内の資金及び自己資本の移動に係る制限等の概要
グループ内の資金及び自己資本の移動に係る特別な制限等はありません。

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、リスクアパタイト・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リスク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、社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います。

(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及びリスクテイク余力の把握をしています。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・フレームワークを導入しています。

リスクアペタイトについては、流動性、自己資本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を設定し、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。

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、リスク管理の基本方針、管理すべきリスクの種類、主要リスクごとの担当役員・所管部署等を定めた「リスク管理規程」を取締役会で決定し、次のとおり基本方針を明らかにしています。

- 1 リスク管理への経営の積極的な関与
- 2 当会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、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います。

(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及びリスクテイク余力の把握をしています。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・フレームワークを導入しております。

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、収益目標や事業計画達成のために進んで受け入れるリスクの種類と総量(リスクアペタイト)を明確にし、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。

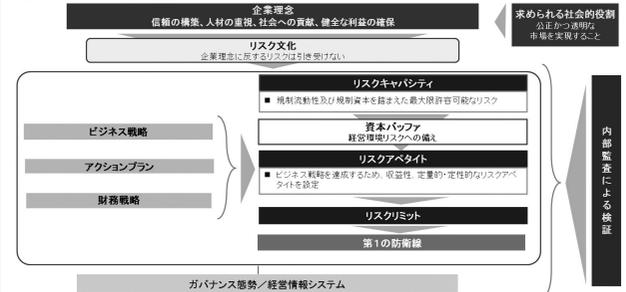
当社グループでは以下の通りリスクアペタイト・フレームワークを規定し、適切な運営を行っております。

(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・フレームワークの概念図



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なっております。

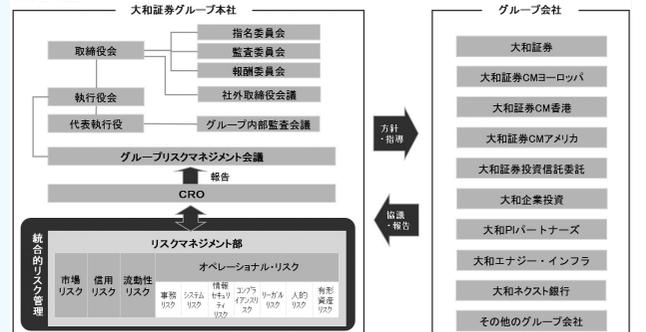
<リスクの特性及び管理方針、リスク管理態勢>

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・リスク等が生じます。さらに、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なっております。

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。

リスク管理態勢



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、或いは信用力の变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) 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。

(6) 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
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 総務部を管轄する執行役	広報部 IR室 総務部	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

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。

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号平成24年7月4日）に規定する正常先債権及び要注意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。破綻懸念先債権に相当する債権については、債権額から担保の処分可能見込額及び保証による回収可能見込額を控除し、その残額のうち必要と認める額を計上しております。破綻先債権及び実質破綻先債権に相当する債権については、債権額から、担保の処分可能見込額及び保証による回収可能見込額を控除した残額を計上しております。全ての債権は、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

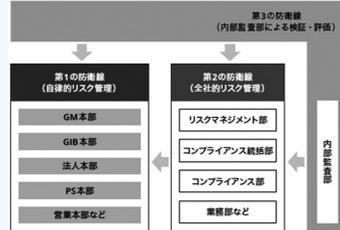
当社グループは信用リスク・アセットの算出にあたっては「標準的手法」を採用しており、リスク・ウェイトの判定において次の格付機関を採用しております。

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・インク
SPグローバル・レーティング

(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」に基づく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号平成24年7月4日）に規定する正常先債権及び要注意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。破綻懸念先債権に相当する債権については、債権額から担保の処分可能見込額及び保証による回収可能見込額を控除し、その残額のうち必要と認める額を計上しております。破綻先債権及び実質破綻先債権に相当する債権については、債権額から、担保の処分可能見込額及び保証による回収可能見込額を控除した残額を計上しております。全ての債権は、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・インク
SPグローバル・レーティング

2018年3月末

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）

債権保全の手段として、主に担保を利用しています。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。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。担保の種類別の残高もモニタリングの対象となっています。

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）

派生商品取引及びレポ形式の取引においては、事前に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って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になっています。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。

債権保全の手段として、主に担保を利用しています。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。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。担保の種類別の残高もモニタリングの対象となっています。

派生商品取引及びレポ取引では、原則として相対ネットリング契約を締結しております。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。

なお、自己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、問題ない水準と考えております。

また、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、将来の期待エクスポージャーをシミュレーションで計算する方式と、与信相当額を時価や想定元本などを用いて計算する方式を併用し、市場で観測されるCDSスプレッドや社内格付と取引の残存期間に応じた引当率で引当金を計算しています。

2019年3月末

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 ネットリ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リ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リングするとともに、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。

二 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信用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、事前に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って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になっています。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、ネットリ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。

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。

担保の種類別の残高もモニタリングの対象となっています。また、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。

派生商品取引及びレポ取引では、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 自行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

自己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。

また、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、将来の期待エクスポージャーをシミュレーションで計算する方式と、与信相当額を時価や想定元本などを用いて計算する方式を併用し、市場で観測されるCDSスプレッドや社内格付と取引の残存期間に応じた引当率で引当金を計算しています。

2018年3月末

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

当社グループは投資家として証券化取引に関与しており、投資及びトレーディング勘定において証券化商品を保有しております。

当該証券化商品には、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227条第4項第3号から第6号まで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、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・インク
SPグローバル・レーティング
フィッチレーティングスリミテッド

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。

2019年3月末

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

当社グループは投資家として証券化取引に関与しており、投資及びトレーディング勘定において証券化商品を保有しております。

当該証券化商品には、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・インク
SPグローバル・レーティング
フィッチレーティングスリミテッド

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。

8. マーケット・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。当社のリスク管理部署ではグループ全体の市場リスクの状況をモニタリングし、経営陣に日次で報告しております。

ロ 内部モデル方式を使用する場合におけるモデルの概要及び適用範囲

当社グループでは内部モデル方式として、一定の信頼水準のもとでの最大予想損失額を示すVaR及び一定のストレス期間のもとでの最大予想損失額を示すストレスVaRを使用しております。その際、過去のマーケットの変動をそのままシナリオとして使用するヒストリカル・シミュレーション法を採用しております。当社グループでは算出されたVaRと損益を比較するバック・テストを実施し、モデルの有効性を検証しております。また、VaRは一定期間のデータに基づいて統計的仮定により算出しているため併せて、過去の大幅なマーケット変動にもとづくシナリオや、仮想的なストレスイベントにもとづくシナリオを用いて、ストレス・テストも実施しています。

ヒストリカル・シミュレーション法の前提は、以下のとおりです。

	VaR	ストレスVaR
保有期間	10営業日	
観測期間	過去520営業日	ストレス期間260営業日
信頼水準	99%	
ヒストリカル・データの更新頻度	日次	
ヒストリカル・データの重み付け	行わない	
リスク・ファクター間の合算	同一のヒストリカル・シミュレーション日付で合算	
価格再評価の手法	原則としてフルバリュエーション法。店頭デリバティブ等、一部の商品についてはセンシティビティ法	
リスク・ファクターの変動の捕捉	一般金利は絶対リターン、エクイティ・為替は相対リターン	

大和証券株式会社、海外子会社、株式会社大和ネクスト銀行(特定取引)の一般市場リスクについて、内部モデル方式を採用しております。

8. マーケット・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、当社グループの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の算出を行いモニタリングを行っている一方で、リスク管理部署でも、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。

ロ 内部モデル方式を使用する場合におけるモデルの概要及び適用範囲

当社グループのうち、大和証券株式会社、海外子会社、株式会社大和ネクスト銀行(特定取引)の一般市場リスクについて、内部モデル方式を採用しております。当該内部モデルにおいては、「為替変動リスク」「金利変動リスク」「株価変動リスク」「商品リスク」に関する一般市場リスクを計測しております。

当社グループでは内部モデル方式として、一定の信頼水準のもとでの最大予想損失額を示すVaR及び一定のストレス期間のもとでの最大予想損失額を示すストレスVaRを使用しております。その際、過去のマーケットの変動をそのままシナリオとして使用するヒストリカル・シミュレーション法を採用しております。

ヒストリカル・シミュレーション法の前提は、以下のとおりです。

	VaR	ストレスVaR
保有期間	10営業日	
観測期間	過去520営業日	ストレス期間260営業日
信頼水準	99%	
ヒストリカル・データの更新頻度	日次	
ヒストリカル・データの重み付け	行わない	
リスク・ファクター間の合算	同一のヒストリカル・シミュレーション日付で合算	
価格再評価の手法	原則としてフルバリュエーション法。店頭デリバティブ等、一部の商品についてはセンシティビティ法	
リスク・ファクターの変動の捕捉	一般金利は絶対リターン、エクイティ・為替は相対リターン	

(補足説明)

- 内部管理に用いるVaRモデルについては、株式に関する個別リスク、クレジットスプレッドリスク等を反映し、より広範囲なマーケット・リスクを捕捉しております。
- 2007年4月2日以降の連続する260営業日について全てVaRを計算し、それが最大値となる260日間をストレス期間としております。
- VaRは一定期間のデータに基づいて統計的仮定により算出しているため、過去の大幅なマーケット変動にもとづくシナリオや仮想的なストレスイベントにもとづくシナリオを用いて、ストレス・テストも併せて実施しています。
- 当社グループでは算出されたVaRと損益を比較するバック・テストを実施し、モデルの有効性を検証しております。
2019年3月期の直近250営業日においては、信頼水準99%のVaRの超過が1回発生しております。
- 当社グループの内部モデルは、1年に1回、内部監査部門による内部監査を受けるとともに、定期的にグループ内の第三者による独立検証を受けております。
- 追加的リスク、包括的リスクについては該当ありません。

2018年3月末

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、当社のオペレーショナル・リスク管理に関する規程に基づき、RCSA（リスク・コントロール・セルフアセスメント）を実施する等、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。

- ロ オペレーショナル・リスク相当額の算出に使用する手法の名称
基礎的手法を採用しております。

10. 信用リスク・アセットの額の算出対象となっている出資その他これに類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

当社グループはトレーディング業務以外にも、投資業務、取引関係上の目的等で投資有価証券等を保有しております。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っております。

当社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。

その他有価証券の時価のある株式等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）、時価を把握することが極めて困難と認められるもの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

主要な子会社および大和証券グループ本社の保有する金融資産およ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、経済価値の変動および期間収益の変動を算出しております。なお、当社グループにおける金利リスクの影響を受ける主たる金融資産・金融負債は「発行社債」及び「長期借入金」です。

2019年3月末

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 オペレーショナル・リスク相当額の算出に使用する手法の名称
基礎的手法を採用しております。

10. 信用リスク・アセットの額の算出対象となっている出資その他これに類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、取引関係上の目的等で投資有価証券等を保有しております。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

その他有価証券の時価のある株式等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）、時価を把握することが極めて困難と認められるもの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。なお、当社グループにおける金利リスクの影響を受ける主たる金融資産・金融負債は「発行社債」及び「長期借入金」です。

2018年3月末

12. 連結貸借対照表の科目が前項に定める自己資本の構成に関する開示項目のいずれかに相当するかについての説明

(単位 百万円)

自己資本の構成に関する開示の参照番号	会計上の連結貸借対照表	告示第3条の規定に基づく連結貸借対照表
資産の部		
流動資産		
	現金・預金	3,694,283
	預託金	348,912
	受取手形及び売掛金	19,479
18,39,54,72,73	有価証券	987,210
16,18,39,54,72,73	トレーディング商品	6,667,033
	約定見返勘定	-
18,39,54,72,73	営業投資有価証券	115,332
	投資損失引当金	△505
	営業貸付金	1,442,939
	仕掛品	479
	信用取引資産	262,963
	有価証券担保貸付金	6,496,752
	立替金	17,549
	短期貸付金	388
	未収収益	35,880
10,75	繰延税金資産	9,021
	その他の流動資産	390,020
	貸倒引当金	△244
	流動資産計	20,487,498
固定資産		
	有形固定資産	124,190
	無形固定資産	105,776
8	のれん	11,170
9	のれん以外	94,605
	投資その他の資産	424,278
18,39,54,72,73	投資有価証券	367,196
10,75	繰延税金資産	3,843
	上記以外	53,239
	固定資産計	654,245
	繰延資産計	-
	資産合計	21,141,743
負債の部		
流動負債		
	支払手形及び買掛金	7,065
	トレーディング商品	5,030,817
	約定見返勘定	407,184
	信用取引負債	71,344
	有価証券担保借入金	5,775,897
	銀行業における預金	3,388,444
	預り金	256,858
	受入保証金	420,039
	短期借入金	1,091,771
	コマーシャルペーパー	105,000
	1年内償還予定の社債	261,494
	未払法人税等	9,211
	繰延税金負債	1,099
	賞与引当金	34,862
	その他の流動負債	175,115
固定負債		
	社債	1,315,349
	長期借入金	1,327,780
	繰延税金負債	14,805
	退職給付に係る負債	41,758
	訴訟損失引当金	24,485
	負のれん	-
	その他の固定負債	6,889
	特別法上の準備金	3,945
	負債合計	19,771,223

2019年3月末

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

(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
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			
資産の部			
流動資産			
	現金・預金	4,153,271	4,153,271
	預託金	324,559	324,559
	受取手形及び売掛金	18,741	18,741
	有価証券 (a)	812,341	812,341
	トレーディング商品 (b)	6,716,066	6,716,066
	約定見返勘定	-	-
	営業投資有価証券 (c)	110,034	110,034
	投資損失引当金	△155	△155
	営業貸付金	1,564,856	1,564,856
	仕掛品	901	901
	信用取引資産	175,034	175,034
	有価証券担保貸付金	5,973,771	5,973,771
	立替金	28,503	28,503
	短期貸付金	350	350
	未収収益	39,229	39,229
	繰延税金資産 (d)	-	-
	その他の流動資産	488,391	488,391
	貸倒引当金	△317	△317
	流動資産計	20,405,580	20,405,580
固定資産			
	有形固定資産	168,089	168,089
	無形固定資産	115,937	115,937
	のれん (e)	10,605	10,605
	のれん以外 (f)	105,331	105,331
	投資その他の資産	437,100	437,100
	投資有価証券 (g)	374,484	374,484
	繰延税金資産 (h)	6,915	6,915
	上記以外	55,699	55,699
	固定資産計	721,126	721,126
	繰延資産計	-	-
	資産の部合計	21,126,706	21,126,706
負債の部			
流動負債			
	支払手形及び買掛金	7,116	7,116
	トレーディング商品	4,747,777	4,747,777
	約定見返勘定	255,804	255,804
	信用取引負債	69,981	69,981
	有価証券担保借入金	5,947,969	5,947,969
	銀行業における預金	3,632,575	3,632,575
	預り金	276,700	276,700
	受入保証金	372,591	372,591
	短期借入金	1,341,415	1,341,415
	コマーシャルペーパー	100,000	100,000
	1年内償還予定の社債	190,772	190,772
	未払法人税等	5,978	5,978
	繰延税金負債	-	-
	賞与引当金	28,436	28,436
	その他の流動負債	104,852	104,852
固定負債			
	社債	1,361,918	1,361,918
	長期借入金	1,336,787	1,336,787
	繰延税金負債	6,071	6,071
	退職給付に係る負債	43,441	43,441
	訴訟損失引当金	25,573	25,573
	負のれん	-	-
	その他の固定負債	10,572	10,572
	特別法上の準備金	3,938	3,938
	負債の部合計	19,870,276	19,870,276

2018年3月末

(単位 百万円)

自己資本の構成に関する開示の参照番号		会計上の 連結貸借対照表	告示第3条の規定に基づく 連結貸借対照表
	純資産の部		
	株主資本		
1a	資本金	247,397	247,397
1a	資本剰余金	230,713	230,713
2	利益剰余金	785,730	785,730
1c	自己株式	△54,310	△54,310
1c	自己株式申込証拠金	3	3
	株主資本合計	1,209,535	1,209,535
	その他の包括利益累計額		
	その他有価証券評価差額金	61,176	61,176
11	繰延ヘッジ損益	△129	△129
	為替換算調整勘定	2,550	2,550
3	その他の包括利益累計額	63,597	63,597
1b	新株予約権	8,790	8,790
34-35,48-49	非支配株主持分	88,596	88,596
	純資産合計	1,370,520	1,370,520

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「【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」の注釈をご参照ください。

2019年3月末

(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
	純資産の部		
	株主資本		
資本金 (i)	247,397	247,397	1a
資本剰余金 (j)	230,633	230,633	1a
利益剰余金 (k)	805,761	805,761	2
自己株式 (l)	△87,320	△87,320	1c
自己株式申込証拠金 (m)	5	5	1c
株主資本合計	1,196,476	1,196,476	
	その他の包括利益累計額		
その他有価証券評価差額金	47,668	47,668	
繰延ヘッジ損益 (n)	△5,611	△5,611	11
為替換算調整勘定	5,942	5,942	
その他の包括利益累計額 (o)	48,000	48,000	3
新株予約権 (p)	8,741	8,741	1b
非支配株主持分 (q)	3,211	3,211	34-35,48-49
純資産の部合計	1,256,430	1,256,430	

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「【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」の注釈をご参照ください。

2018年3月末

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

【2018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	5,604,819	751,323	973,771	3,879,725
海外	320,531	34,892	29,153	256,484
地域別合計	5,925,350	786,216	1,002,924	4,136,210
ソブリン	4,345,865	646,375	610,979	3,088,510
金融機関	703,002	-	30,505	672,496
法人	294,251	130,733	63,517	100,000
個人	-	-	-	-
CCP	53	-	-	53
その他	582,178	9,107	297,922	275,149
業種別合計	5,925,350	786,216	1,002,924	4,136,210
1年以下	274,135	95,953	125,563	52,618
1年超3年以下	48,008	-	48,008	-
3年超5年以下	121,696	-	121,696	-
5年超7年以下	107,973	-	107,973	-
7年超	265,900	-	265,900	-
期間の定めのないもの	5,107,635	690,262	333,781	4,083,591
残存期間別合計	5,925,350	786,216	1,002,924	4,136,210

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)

引当金の種類	地域	2018年3月末	期中増減額
一般貸倒引当金		-	-
個別貸倒引当金	日本	493	△12,885
	海外	205	37
特定海外債権引当金		-	-
引当金の種類	業種/取引相手	2018年3月末	期中増減額
一般貸倒引当金		-	-
個別貸倒引当金	ソブリン	-	-
	金融機関	-	-
	法人	579	18
	個人	-	-
	その他	119	△12,866
特定海外債権引当金		-	-

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	92	1	10	-	80
海外	531	132	3	-	395
地域別合計	624	134	13	-	475
ソブリン	-	-	-	-	-
金融機関	-	-	-	-	-
法人	624	134	13	-	475
個人	-	-	-	-	-
CCP	-	-	-	-	-
その他	-	-	-	-	-
業種別合計	624	134	13	-	475

2019年3月末

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

【2019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	6,088,175	837,642	820,760	4,429,773
海外	337,185	61,902	27,545	247,738
地域別合計	6,425,360	899,544	848,305	4,677,511
ソブリン	4,895,836	687,856	539,392	3,668,587
金融機関	597,017	-	19,204	577,813
法人	331,065	200,097	26,570	104,397
個人	-	-	-	-
CCP	5,442	-	-	5,442
その他	595,997	11,590	263,137	321,269
業種別合計	6,425,360	899,544	848,305	4,677,511
1年以下	230,605	125,416	81,256	23,932
1年超3年以下	62,717	1,426	61,252	39
3年超5年以下	90,949	-	90,864	84
5年超7年以下	89,417	-	89,327	90
7年超	261,487	-	261,416	71
期間の定めのないもの	5,690,183	772,702	264,187	4,653,294
残存期間別合計	6,425,360	899,544	848,305	4,677,511

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)

		2019年3月末		
		期末残高	引当金の額	償却額
日本	655	493	-	
海外	2,629	118	-	
地域別合計	3,285	612	-	
ソブリン	-	-	-	
金融機関	39	-	-	
法人	3,051	497	-	
個人	-	-	-	
その他	194	115	-	
業種別合計	3,285	612	-	

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	163	143	10	-	9
海外	673	48	11	-	615
地域別合計	836	191	21	-	624
ソブリン	-	-	-	-	-
金融機関	49	-	10	-	39
法人	786	191	10	-	584
個人	-	-	-	-	-
CCP	-	-	-	-	-
その他	-	-	-	-	-
業種別合計	836	191	21	-	624

2018年3月末

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. 複数の資産及び取引を裏付とするエクスポージャーで、リスク・ウェイトを直接に判定することができないものの額

(単位 百万円)

	エクスポージャーの額
合計	717,507

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	
		当期末	前期末	当期末	前期末
1	信用リスク	903,175		72,254	
2	うち、標準的手法適用分	747,448		59,795	
3	うち、内部格付手法適用分	-		-	
	うち、重要な出資のエクスポージャー	-		-	
	うち、リース取引における見積 残存価額のエクスポージャー	-		-	
	その他	155,726		12,458	
4	カウンターパーティ信用リスク	1,261,575		100,926	
5	うち、SA-CCR適用分	-		-	
	うち、カレント・エクスポ ージャー方式適用分	330,889		26,471	
6	うち、期待エクスポージャー 方式適用分	-		-	
	うち、CVAリスク	564,809		45,184	
	うち、中央清算機関関連工 クスポージャー	27,929		2,234	
	その他	337,948		27,035	
7	マーケット・ベース方式に基 づく株式等エクスポージャー	-		-	
	複数の資産及び取引を裏付 けとするエクスポージャー	301,418		24,113	
	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	-		-	
11	未決済取引	391		31	
12	信用リスク・アセットの額の 算出対象となっている証券 化エクスポージャー	138,181		11,054	
13	うち、内部格付手法におけ る外部格付準拠方式又は 内部評価方式適用分	-		-	
14	うち、内部格付手法におけ る指定関数方式適用分	-		-	
15	うち、標準的手法適用分	138,181		11,054	
	うち、1250%のリスク・ ウェイト適用分	-		-	
16	マーケット・リスク	1,461,548		116,923	
17	うち、標準的方式適用分	860,281		68,822	
18	うち、内部モデル方式適用分	601,266		48,101	
19	オペレーショナル・リスク	1,028,878		82,310	
20	うち、基礎的手法適用分	1,028,878		82,310	
21	うち、粗利益配分手法適用分	-		-	
22	うち、先進的計測手法適用分	-		-	
23	特定項目のうち、調整項目に算入さ れない部分に係るエクスポージャー	30,709		2,456	
	経過措置によりリスク・アセ ットの額に算入されるものの額	-		-	
24	フロア調整	-		-	
25	合計	5,125,879		410,070	

2019年3月末

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. 複数の資産及び取引を裏付とするエクスポージャーで、リスク・ウェイトを直接に判定することができないものの額

(単位 百万円)

	エクスポージャーの額
リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・ アセットのみなし計算(ルック・スルー方式)	645,854
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)	60,251
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%)	52
合計	706,159

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	
		2019年3月末	2018年3月末	2019年3月末	2018年3月末
1	信用リスク	779,968	903,175	62,397	72,254
2	うち、標準的手法適用分	581,678	747,448	46,534	59,795
3	うち、内部格付手法適用分	-	-	-	-
	うち、重要な出資のエクスポ ージャー	-	-	-	-
	うち、リース取引における見積 残存価額のエクスポージャー	-	-	-	-
	その他	198,289	155,726	15,863	12,458
4	カウンターパーティ信用リスク	992,548	1,261,575	79,403	100,926
5	うち、SA-CCR適用分	331,892	-	26,551	-
	うち、カレント・エクスポ ージャー方式適用分	-	330,889	-	26,471
6	うち、期待エクスポージャー 方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	345,076	564,809	27,606	45,184
	うち、中央清算機関関連工 クスポージャー	14,842	27,929	1,187	2,234
	その他	300,737	337,948	24,058	27,035
7	マーケット・ベース方式に基 づく株式等エクスポージャー	-	-	-	-
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リス ク・アセットのみなし計算(ルック・スルー方式)	336,045		26,883	
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リス ク・アセットのみなし計算(マンドート方式)	60,870		4,869	
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リス ク・アセットのみなし計算(蓋然性方式250%)	-		-	
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リス ク・アセットのみなし計算(蓋然性方式400%)	-		-	
10	リスク・ウェイトのみなし計算 又は信用リスク・アセットのみなし計算 (フォールバック方式1250%)	653		52	
	複数の資産及び取引を裏付 けとするエクスポージャー		301,418		24,113
	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		-		-
11	未決済取引	165	391	13	31
12	信用リスク・アセットの額の 算出対象となっている証券 化エクスポージャー	145,587	138,181	11,647	11,054
13	うち、内部格付手法準拠方 式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	145,587		11,647	
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-		-	
	うち、内部格付手法におけ る外部格付準拠方式又は 内部評価方式適用分		-		-
	うち、内部格付手法におけ る指定関数方式適用分		-		-
	うち、標準的手法適用分		138,181		11,054
	うち、1250%のリスク・ ウェイト適用分		-		-
16	マーケット・リスク	1,536,044	1,461,548	122,883	116,923
17	うち、標準的方式適用分	838,957	860,281	67,116	68,822
18	うち、内部モデル方式適用分	697,087	601,266	55,766	48,101
19	オペレーショナル・リスク	975,088	1,028,878	78,007	82,310
20	うち、基礎的手法適用分	975,088	1,028,878	78,007	82,310
21	うち、粗利益配分手法適用分	-	-	-	-
22	うち、先進的計測手法適用分	-	-	-	-
23	特定項目のうち、調整項目に算入さ れない部分に係るエクスポージャー	126,235	30,709	10,098	2,456
	経過措置によりリスク・アセ ットの額に算入されるものの額	-	-	-	-
24	フロア調整	-	-	-	-
25	合計	4,953,208	5,125,879	396,256	410,070

2018年3月末

2019年3月末

(単位 百万円)

国際株式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2019年3月末	2018年12月末	2019年3月末	2018年12月末
1	信用リスク	779,968	853,398	62,397	68,271
2	うち、標準的手法適用分	581,678	675,740	46,534	54,059
3	うち、内部格付手法適用分	—	—	—	—
	うち、重要な出資のエクスポージャー	—	—	—	—
	うち、リース取引における見積 残存価額のエクスポージャー	—	—	—	—
	その他	198,289	177,658	15,863	14,212
4	カウンターパーティ信用リスク	992,548	1,183,985	79,403	94,718
5	うち、SA-CCR適用分	331,892	—	26,551	—
	うち、カレント・エクスポ ージャー方式適用分	—	310,811	—	24,864
6	うち、期待エクスポージャー 方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	345,076	512,779	27,606	41,022
	うち、中央清算機関関連工 クスポージャー	14,842	30,519	1,187	2,441
	その他	300,737	329,874	24,058	26,389
7	マーケット・ベース方式に基づ く株式等エクスポージャー	—	—	—	—
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク アセットのみなし計算(ルック・スルー方式)	336,045	—	26,883	—
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク アセットのみなし計算(マウント方式)	60,870	—	4,869	—
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク アセットのみなし計算(蓋然性方式250%)	—	—	—	—
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク アセットのみなし計算(蓋然性方式400%)	—	—	—	—
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は 信用リスク・アセットのみなし計算 (フォールバック方式1250%)	653	—	52	—
	複数の資産及び取引を裏付 けとするエクスポージャー	—	404,549	—	32,363
	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	—	—	—	—
11	未決済取引	165	109	13	8
12	信用リスク・アセットの額の 算出対象となっている証券 化エクスポージャー	145,587	140,360	11,647	11,228
13	うち、内部格付手法標準方 式又は内部評価方式適用分	—	—	—	—
14	うち、外部格付標準方式適用分	145,587	—	11,647	—
15	うち、標準的手法標準方式適用分	—	—	—	—
	うち、内部格付手法におけ る外部格付標準方式又は 内部評価方式適用分	—	—	—	—
	うち、内部格付手法におけ る指定関数方式適用分	—	—	—	—
	うち、標準的手法適用分	—	140,360	—	11,228
	うち、1250%のリスク・ ウェイト適用分	—	—	—	—
16	マーケット・リスク	1,536,044	1,334,804	122,883	106,784
17	うち、標準的方式適用分	838,957	847,602	67,116	67,808
18	うち、内部モデル方式適用分	697,087	487,201	55,766	38,976
19	オペレーショナル・リスク	975,088	981,734	78,007	78,538
20	うち、基礎的手法適用分	975,088	981,734	78,007	78,538
21	うち、粗利益配分手法適用分	—	—	—	—
22	うち、先進的計測手法適用分	—	—	—	—
23	特定項目のうち、調整項目に算入さ れない部分に係るエクスポージャー	126,235	13,023	10,098	1,041
	経過措置によりリスク・アセッ トの額に算入されるものの額	—	—	—	—
24	フロア調整	—	—	—	—
25	合計	4,953,208	4,911,966	396,256	392,957

2018年3月末

【L1】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・カテゴリとの対応関係

L11 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	3,694,283	3,694,273	-	-	218,385	-
2	預託金	348,912	348,912	-	-	16,105	-
3	受取手形及び売掛金	19,479	19,375	-	-	-	-
4	有価証券	987,210	957,191	-	18,096	424,477	-
5	トレーディング商品	6,667,033	-	2,355,646	-	6,671,802	△4,769
6	約定見返勘定	-	-	-	-	-	-
7	営業投資有価証券	115,332	115,332	-	-	15,025	-
8	投資損失引当金	△505	△505	-	-	-	-
9	営業貸付金	1,442,939	780,887	-	662,051	528,799	-
10	仕掛品	479	479	-	-	-	-
11	信用取引資産	262,963	-	262,963	-	-	-
12	有価証券担保貸付金	6,496,752	-	7,235,571	-	2,937,968	-
13	立替金	17,549	17,548	-	-	102	-
14	短期貸付金	388	388	-	-	81	-
15	未収収益	35,880	34,990	-	-	20,297	-
16	繰延税金資産	9,021	9,021	-	-	51	-
17	その他の流動資産	390,020	170,854	202,600	-	70,406	13,417
18	貸倒引当金	△244	△133	-	-	-	-
19	流動資産計	20,487,498	6,148,616	10,056,782	680,147	10,903,498	8,647
20	有形固定資産	124,190	-	-	-	3,408	120,782
21	無形固定資産	105,776	-	-	-	10,113	95,663
22	のれん	11,170	-	-	-	7,079	4,091
23	のれん以外	94,605	-	-	-	3,034	91,571
24	投資その他の資産	424,278	424,355	-	-	53,601	-
25	投資有価証券	367,196	367,196	-	-	25,414	-
26	繰延税金資産	3,843	3,926	-	-	3,054	-
27	上記以外	53,239	53,232	-	-	25,133	-
28	固定資産計	654,245	424,355	-	-	67,122	216,445
29	繰延資産計	-	-	-	-	-	-
30	資産合計	21,141,743	6,572,972	10,056,782	680,147	10,970,620	225,093

(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。

2019年3月末

【L1】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・カテゴリとの対応関係

L11 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	4,153,271	4,153,409	-	-	204,662	-
2	預託金	324,559	324,558	-	-	15,554	-
3	受取手形及び売掛金	18,741	18,638	-	-	-	-
4	有価証券	812,341	787,637	-	24,704	283,591	-
5	トレーディング商品	6,716,066	-	2,796,954	-	6,719,936	△3,870
6	約定見返勘定	-	12	-	-	-	-
7	営業投資有価証券	110,034	110,033	-	-	23,887	-
8	投資損失引当金	△155	△155	-	-	-	-
9	営業貸付金	1,564,856	893,659	-	671,197	535,624	-
10	仕掛品	901	901	-	-	-	-
11	信用取引資産	175,034	-	175,030	-	-	-
12	有価証券担保貸付金	5,973,771	-	6,365,924	-	3,901,989	-
13	立替金	28,503	28,501	-	-	107	-
14	短期貸付金	350	350	-	-	-	-
15	未収収益	39,229	39,048	-	-	19,699	-
16	繰延税金資産	-	-	-	-	-	-
17	その他の流動資産	488,391	293,116	158,121	-	79,902	30,313
18	貸倒引当金	△317	△227	-	-	△227	-
19	流動資産計	20,405,580	6,649,486	9,496,030	695,901	11,784,724	26,442
20	有形固定資産	168,089	168,089	-	-	3,235	-
21	無形固定資産	115,937	-	-	-	9,969	115,937
22	のれん	10,605	-	-	-	2,254	10,605
23	のれん以外	105,331	-	-	-	7,715	105,331
24	投資その他の資産	437,100	436,999	-	-	60,358	-
25	投資有価証券	374,484	374,383	-	-	22,374	-
26	繰延税金資産	6,915	6,915	-	-	-	-
27	上記以外	55,699	55,698	-	-	37,984	-
28	固定資産計	721,126	605,088	-	-	73,562	115,937
29	繰延資産計	-	-	-	-	-	-
30	資産合計	21,126,706	7,254,576	9,496,030	695,901	11,858,286	142,379

(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。

2018年3月末

L11 その2

(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		
負債								
31	支払手形及び買掛金	7,065	-	-	-	-	7,065	
32	トレーディング商品	5,030,817	-	2,117,532	-	5,007,437	-	
33	約定見返勘定	407,184	803	18,808	-	13,909	387,572	
34	信用取引負債	71,344	-	71,344	-	-	-	
35	有価証券担保借入金	5,775,897	-	6,514,876	-	4,187,775	-	
36	銀行業における預金	3,388,444	-	-	-	300,540	3,087,904	
37	預り金	256,858	-	-	-	43,673	213,185	
38	受入保証金	420,039	-	-	-	3,293	416,746	
39	短期借入金	1,091,771	-	-	-	58,275	1,033,496	
40	コマーシャルペーパー	105,000	-	-	-	-	105,000	
41	1年以内償還予定の社債	261,494	-	-	-	-	261,494	
42	未払法人税等	9,211	-	-	-	-	9,211	
43	繰延税金負債	1,099	-	-	-	-	1,099	
44	賞与引当金	34,862	-	-	-	11,515	23,347	
45	その他の流動負債	175,115	805	16,180	-	98,125	158,002	
46	社債	1,315,349	-	-	-	42,187	1,273,162	
47	長期借入金	1,327,780	-	-	-	-	1,327,780	
48	繰延税金負債	14,805	-	-	-	-	14,805	
49	退職給付に係る負債	41,758	-	-	-	-	41,758	
50	訴訟損失引当金	24,485	-	-	-	22,517	1,968	
51	負ののれん	-	-	-	-	-	-	
52	その他の固定負債	6,889	-	-	-	991	5,898	
53	特別法上の準備金	3,945	-	-	-	-	3,945	
54	負債合計	19,771,223	1,608	8,738,742	-	9,790,238	8,373,447	

(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。

2019年3月末

L11 その2

(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		
負債								
31	支払手形及び買掛金	7,116	-	-	-	-	7,116	
32	トレーディング商品	4,747,777	-	2,638,120	-	4,777,699	-	
33	約定見返勘定	255,804	-	7,683	-	158,041	70,678	
34	信用取引負債	69,981	-	69,981	-	-	-	
35	有価証券担保借入金	5,947,969	-	6,344,154	-	4,906,405	-	
36	銀行業における預金	3,632,575	-	-	-	300,540	3,332,035	
37	預り金	276,700	-	-	-	51,965	224,735	
38	受入保証金	372,591	-	-	-	9,925	362,666	
39	短期借入金	1,341,415	-	-	-	-	1,274,838	
40	コマーシャルペーパー	100,000	-	-	-	-	100,000	
41	1年以内償還予定の社債	190,772	-	-	-	-	190,772	
42	未払法人税等	5,978	-	-	-	676	5,302	
43	繰延税金負債	-	-	-	-	-	-	
44	賞与引当金	28,436	-	-	-	13,044	15,392	
45	その他の流動負債	104,852	272	17,746	-	49,650	86,832	
46	社債	1,361,918	-	-	-	44,665	1,317,253	
47	長期借入金	1,336,787	-	-	-	-	1,336,787	
48	繰延税金負債	6,071	-	-	-	1,406	4,665	
49	退職給付に係る負債	43,441	-	-	-	-	43,441	
50	訴訟損失引当金	25,573	-	-	-	23,774	1,799	
51	負ののれん	-	-	-	-	-	-	
52	その他の固定負債	10,572	-	-	-	1,203	9,369	
53	特別法上の準備金	3,938	-	-	-	-	3,938	
54	負債合計	19,870,276	272	9,077,686	-	10,405,570	8,387,627	

(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。

2018年3月末

【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

(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	自己資本比率規制上の連結範囲に基づく資産の額	21,141,743	6,572,972	10,056,782	680,147	10,970,620
2	自己資本比率規制上の連結範囲に基づく負債の額	19,771,223	1,608	8,738,742	-	9,790,238
3	自己資本比率規制上の連結範囲に基づく資産及び負債の純額	1,370,520	6,571,363	1,318,039	680,147	1,180,382
4	オフ・バランスシートの額	167,569	15,945	151,623	-	-
5	保守的な公正価値調整による差異	-	-	-	-	-
6	ネットィングルールの相違による差異（項番2に含まれる額を除く。）	-	-	-	-	-
7	引当て及び償却を勘案することによる差異	-	-	-	-	-
8	調整項目（プルデンシャル・フィルター）による差異	-	-	-	-	-
9	カレント・エクスポージャー方式適用に伴う調整	2,966,663	-	2,966,663	-	-
10	レボ形式の取引について、ネットィング効果及び担保による信用リスク削減手法の効果の勘案による調整	14,133,866	-	14,133,866	-	-
11	その他の差異	2,637,038	226,657	△180,850	△10,760	-
12	自己資本比率規制上のエクスポージャーの額	14,009,083	6,706,867	2,440,750	690,908	1,180,382

(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。

2019年3月末

【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

(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	自己資本比率規制上の連結範囲に基づく資産の額	20,984,327	7,254,576	9,496,030	695,901	11,858,286
2	自己資本比率規制上の連結範囲に基づく負債の額	11,482,648	272	9,077,686	-	10,405,570
3	自己資本比率規制上の連結範囲に基づく資産及び負債の純額	9,501,678	7,254,303	418,343	695,901	1,452,715
4	オフ・バランスシートの額	114,960	5,841	109,118	-	-
5	保守的な公正価値調整による差異	-	-	-	-	-
6	ネットィングルールの相違による差異（項番2に含まれる額を除く。）	-	-	-	-	-
7	引当て及び償却を勘案することによる差異	-	-	-	-	-
8	調整項目（プルデンシャル・フィルター）による差異	-	-	-	-	-
9	デリバティブ取引等による差異	4,859,650	-	4,859,650	-	-
10	レボ形式の取引について、ネットィング効果及び担保による信用リスク削減手法の効果の勘案による調整	13,700,864	-	13,700,864	-	-
11	その他の差異	△207,129	19,512	△215,736	△10,905	-
12	自己資本比率規制上のエクスポージャーの額	10,709,038	7,132,430	1,417,085	706,807	1,452,715

(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。

2018年3月末

【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	-	786,264	48	786,216
2 有価証券(うち負債性のもの)	-	705,002	-	705,002
3 その他オン・バランスシートの 資産(うち負債性のもの)	475	3,790,742	1,710	3,789,507
4 オン・バランスシートの資産 の合計(1+2+3)	475	5,282,009	1,758	5,280,726
オフ・バランスシートの資産				
5 支払承諾等	-	7,691	-	7,691
6 コミットメント等	-	25,574	-	25,574
7 オフ・バランスシートの資産 の合計(5+6)	-	33,266	-	33,266
合計				
8 合計(4+7)	475	5,315,276	1,758	5,313,993

(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。

2019年3月末

【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	-	899,592	47	899,544
2 有価証券(うち負債性のもの)	-	585,167	-	585,167
3 その他オン・バランスシートの 資産(うち負債性のもの)	624	4,271,267	1,696	4,270,195
4 オン・バランスシートの資産 の合計(1+2+3)	624	5,756,026	1,744	5,754,907
オフ・バランスシートの資産				
5 支払承諾等	-	1,817	-	1,817
6 コミットメント等	-	19,035	-	19,035
7 オフ・バランスシートの資産 の合計(5+6)	-	20,852	-	20,852
合計				
8 合計(4+7)	624	5,776,879	1,744	5,775,760

(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:2018年3月末 当期末:2019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		559
2 貸出金・有価証券等	デフォルトした額	116
3 (うち負債性のもの)	非デフォルト状態へ復帰した額	8
4 の当期中の要因別の	償却された額	-
5 変動額	その他の変動額	△43
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)		624

(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	736,023	50,192	50,192	-	-
2 有価証券 (負債性のもの)	705,002	-	-	-	-
3 その他オン・バラン スシートの資産 (負債性のもの)	3,789,508	-	-	-	-
4 合計(1+2+3)	5,230,534	50,192	50,192	-	-
5 うちデフォルト したものの	475	-	-	-	-

【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	793,049	106,494	106,494	-	-
2 有価証券 (負債性のもの)	585,167	-	-	-	-
3 その他オン・バラン スシートの資産 (負債性のもの)	4,270,189	5	5	-	-
4 合計(1+2+3)	5,648,407	106,500	106,500	-	-
5 うちデフォルト したものの	624	-	-	-	-

2018年3月末

【CR4】標準的手法－信用リスク・エクスポージャーと信用リスク削減手法の効果
(単位 百万円、%)

資産クラス	CCF・信用リスク削減手法適用前のエクスポージャー		CCF・信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー		信用リスク・アセットの額	リスク・ウェイトの加重平均値 (RWAdensity)
	オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額	オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額		
1 現金	-	-	-	-	-	-
2 日本国政府及び日本銀行向け	3,807,879	-	3,807,879	-	-	-
3 外国の中央政府及び中央銀行向け	195,853	-	195,853	-	59	0.03%
4 国際決済銀行等向け	-	-	-	-	-	-
5 我が国の地方公共団体向け	35,059	-	35,059	-	-	-
6 外国の中央政府等以外の公共部門向け	2,409	-	2,409	-	541	22.46%
7 国際開発銀行向け	10,910	-	10,910	-	-	-
8 地方公共団体金融機構向け	28,127	-	28,127	-	5,618	19.97%
9 我が国の政府関係機関向け	265,616	-	265,616	-	29,801	11.22%
10 地方三公社向け	8	-	8	-	1	12.50%
11 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	702,983	19,011	702,983	3,802	152,310	21.55%
12 法人等向け	281,613	1,847	231,421	1,847	191,892	82.26%
13 中小企業等向け及び個人向け	-	-	-	-	-	-
14 抵当権付住宅ローン	-	-	-	-	-	-
15 不動産取得等事業向け	9,176	12,410	9,176	8,261	17,437	100.00%
16 三月以上延滞等(抵当権付住宅ローンを除く。)	475	-	475	-	713	150.11%
17 抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞	-	-	-	-	-	-
18 取立未済手形	-	-	-	-	-	-
19 信用保証協会等による保証付	-	-	-	-	-	-
20 株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	-	-	-	-	-	-
21 出資等(重要な出資を除く。)	298,609	-	298,609	-	349,071	116.90%
22 合計	5,638,722	33,269	5,588,530	13,910	747,448	13.34%

2019年3月末

【CR4】標準的手法－信用リスク・エクスポージャーと信用リスク削減手法の効果
(単位 百万円、%)

資産クラス	CCF・信用リスク削減手法適用前のエクスポージャー		CCF・信用リスク削減手法適用後のエクスポージャー		信用リスク・アセットの額	リスク・ウェイトの加重平均値 (RWAdensity)
	オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額	オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額		
1 現金	-	-	-	-	-	-
2 日本国政府及び日本銀行向け	4,516,291	-	4,516,291	-	-	-
3 外国の中央政府及び中央銀行向け	131,409	-	131,409	-	30	0.02%
4 国際決済銀行等向け	-	-	-	-	-	-
5 我が国の地方公共団体向け	2,851	-	2,851	-	-	-
6 外国の中央政府等以外の公共部門向け	2,760	-	2,760	-	624	22.61%
7 国際開発銀行向け	157	-	157	-	-	-
8 地方公共団体金融機構向け	1,367	-	1,367	-	271	19.82%
9 我が国の政府関係機関向け	240,998	-	240,998	-	26,167	10.86%
10 地方三公社向け	-	-	-	-	-	-
11 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	596,978	19,035	596,978	3,807	127,447	21.21%
12 法人等向け	313,020	1,819	206,520	1,819	191,234	91.79%
13 中小企業等向け及び個人向け	-	-	-	-	-	-
14 抵当権付住宅ローン	-	-	-	-	-	-
15 不動産取得等事業向け	11,590	3,663	11,590	3,663	15,253	100.00%
16 三月以上延滞等(抵当権付住宅ローンを除く。)	624	-	624	-	936	150.00%
17 抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞	-	-	-	-	-	-
18 取立未済手形	-	-	-	-	-	-
19 信用保証協会等による保証付	-	-	-	-	-	-
20 株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付	-	-	-	-	-	-
21 出資等(重要な出資を除く。)	219,713	-	219,713	-	219,713	100.00%
22 合計	6,037,764	24,518	5,931,264	9,289	581,679	9.79%

2018年3月末

【CR5】標準的手法－資産クラス及びリスク・ウェイト別の信用リスク・エクスポージャー

CR5 その1

(単位 百万円)

資産クラス	リスク・ウェイト	信用リスク・エクスポージャーの額 (CCF・信用リスク削減手法適用後)					
		0%	10%	20%	35%	50%	75%
1 現金		-	-	-	-	-	-
2 日本国政府及び日本銀行向け		3,807,879	-	-	-	-	-
3 外国の中央政府及び中央銀行向け		195,735	-	1	-	113	-
4 国際決済銀行等向け		-	-	-	-	-	-
5 我が国の地方公共団体向け		35,059	-	-	-	-	-
6 外国の中央政府等以外の公共部門向け		-	-	2,334	-	-	-
7 国際開発銀行向け		10,910	-	-	-	-	-
8 地方公共団体金融機構向け		-	72	28,054	-	-	-
9 我が国の政府関係機関向け		-	233,218	32,398	-	-	-
10 地方三公社向け		-	-	8	-	-	-
11 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け		-	-	676,781	-	26,100	-
12 法人等向け		-	-	36,620	-	24,158	-
13 中小企業等向け及び個人向け		-	-	-	-	-	-
14 抵当権付住宅ローン		-	-	-	-	-	-
15 不動産取得等事業向け		-	-	-	-	-	-
16 三月以上延滞等(抵当権付住宅ローンを除く。)		-	-	-	-	-	-
17 抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞		-	-	-	-	-	-
18 取立未済手形		-	-	-	-	-	-
19 信用保証協会等による保証付		-	-	-	-	-	-
20 株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付		-	-	-	-	-	-
21 出資等(重要な出資を除く。)		-	-	-	-	-	-
22 合計		4,049,584	233,291	776,198	-	50,373	-

CR5 その2

(単位 百万円)

資産クラス	リスク・ウェイト	信用リスク・エクスポージャーの額 (CCF・信用リスク削減手法適用後)				
		100%	150%	250%	1250%	合計
1 現金		-	-	-	-	-
2 日本国政府及び日本銀行向け		-	-	-	-	3,807,879
3 外国の中央政府及び中央銀行向け		2	-	-	-	195,853
4 国際決済銀行等向け		-	-	-	-	-
5 我が国の地方公共団体向け		-	-	-	-	35,059
6 外国の中央政府等以外の公共部門向け		74	-	-	-	2,409
7 国際開発銀行向け		-	-	-	-	10,910
8 地方公共団体金融機構向け		-	-	-	-	28,127
9 我が国の政府関係機関向け		-	-	-	-	265,616
10 地方三公社向け		-	-	-	-	8
11 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け		3,903	-	-	-	706,785
12 法人等向け		172,489	-	-	-	233,268
13 中小企業等向け及び個人向け		-	-	-	-	-
14 抵当権付住宅ローン		-	-	-	-	-
15 不動産取得等事業向け		17,437	-	-	-	17,437
16 三月以上延滞等(抵当権付住宅ローンを除く。)		-	475	-	-	475
17 抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞		-	-	-	-	-
18 取立未済手形		-	-	-	-	-
19 信用保証協会等による保証付		-	-	-	-	-
20 株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付		-	-	-	-	-
21 出資等(重要な出資を除く。)		264,967	-	33,641	-	298,609
22 合計		458,875	475	33,641	-	5,602,441

2019年3月末

【CR5】標準的手法－資産クラス及びリスク・ウェイト別の信用リスク・エクスポージャー

CR5 その1

(単位 百万円)

資産クラス	リスク・ウェイト	信用リスク・エクスポージャーの額 (CCF・信用リスク削減手法適用後)					
		0%	10%	20%	35%	50%	75%
1 現金		-	-	-	-	-	-
2 日本国政府及び日本銀行向け		4,516,291	-	-	-	-	-
3 外国の中央政府及び中央銀行向け		131,344	-	9	-	55	-
4 国際決済銀行等向け		-	-	-	-	-	-
5 我が国の地方公共団体向け		2,851	-	-	-	-	-
6 外国の中央政府等以外の公共部門向け		-	-	2,669	-	-	-
7 国際開発銀行向け		157	-	-	-	-	-
8 地方公共団体金融機構向け		-	17	1,349	-	-	-
9 我が国の政府関係機関向け		-	220,318	20,679	-	-	-
10 地方三公社向け		-	-	-	-	-	-
11 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け		-	-	583,041	-	13,811	-
12 法人等向け		-	-	17,880	-	5,601	-
13 中小企業等向け及び個人向け		-	-	-	-	-	-
14 抵当権付住宅ローン		-	-	-	-	-	-
15 不動産取得等事業向け		-	-	-	-	-	-
16 三月以上延滞等(抵当権付住宅ローンを除く。)		-	-	-	-	-	-
17 抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞		-	-	-	-	-	-
18 取立未済手形		-	-	-	-	-	-
19 信用保証協会等による保証付		-	-	-	-	-	-
20 株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付		-	-	-	-	-	-
21 出資等(重要な出資を除く。)		-	-	-	-	-	-
22 合計		4,650,644	220,336	625,631	-	19,467	-

CR5 その2

(単位 百万円)

資産クラス	リスク・ウェイト	信用リスク・エクスポージャーの額 (CCF・信用リスク削減手法適用後)				
		100%	150%	250%	1250%	合計
1 現金		-	-	-	-	-
2 日本国政府及び日本銀行向け		-	-	-	-	4,516,291
3 外国の中央政府及び中央銀行向け		-	-	-	-	131,409
4 国際決済銀行等向け		-	-	-	-	-
5 我が国の地方公共団体向け		-	-	-	-	2,851
6 外国の中央政府等以外の公共部門向け		90	-	-	-	2,760
7 国際開発銀行向け		-	-	-	-	157
8 地方公共団体金融機構向け		-	-	-	-	1,367
9 我が国の政府関係機関向け		-	-	-	-	240,998
10 地方三公社向け		-	-	-	-	-
11 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け		3,933	-	-	-	600,785
12 法人等向け		184,857	-	-	-	208,339
13 中小企業等向け及び個人向け		-	-	-	-	-
14 抵当権付住宅ローン		-	-	-	-	-
15 不動産取得等事業向け		15,253	-	-	-	15,253
16 三月以上延滞等(抵当権付住宅ローンを除く。)		-	624	-	-	624
17 抵当権付住宅ローンに係る三月以上延滞		-	-	-	-	-
18 取立未済手形		-	-	-	-	-
19 信用保証協会等による保証付		-	-	-	-	-
20 株式会社地域経済活性化支援機構等による保証付		-	-	-	-	-
21 出資等(重要な出資を除く。)		219,713	-	-	-	219,713
22 合計		423,848	624	-	-	5,940,554

2018年3月末

【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)

	再構築 コスト	アドオン	実効 EPE	規制上の エク スポー ジャー の算定に 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	-	-	-	1.4	-	-
カレント・エクスポージャー 方式	480,436	664,416	-	-	857,287	330,889
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	-	-	-	-	583,366	337,948
5 エクスポージャー変動推計モ デル	-	-	-	-	-	-
6 合計	-	-	-	-	-	668,837

【CCR2】CVAリスクに対する資本賦課

(単位 百万円)

	信用リスク 削減手法適 用後の エクスポ ージャー	リスク・ アセットの 額 (CVAリス ク相当額を 8%で除して 得た額)
1 先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	-	-
2 (i) CVAバリュー・アット・リスクの額(乗数適用後)	-	-
3 (ii) CVAストレステス・バリュー・アット・リスクの額(乗 数適用後)	-	-
4 標準的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	750,831	564,809
5 CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	750,831	564,809

【CCR3】業種別及びリスク・ウェイト別のカウンターパーティ信用リスク・エク
スポージャー

CCR3 その1 (単位 百万円)

業種	リスク・ウェイト	与信相当額(信用リスク削減効果勘案後)		
		0%	10%	20%
1 日本国政府及び日本銀行向け		1,948	-	-
2 外国の中央政府及び中央銀行向け		1,564	-	-
3 国際決済銀行等向け		3,606	-	-
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		-	-	48,987
6 国際開発銀行向け		5,183	-	-
7 地方公共団体金融機構向け		-	6,700	-
8 我が国の政府関係機関向け		-	5,897	-
9 地方三公社向け		-	-	-
10 金融機関及び第一種金融商品取引 業者向け		-	-	866,713
11 法人等向け		-	-	8,393
12 中小企業等向け及び個人向け		-	-	-
13 上記以外		-	-	-
14 合計		12,303	12,597	924,094

2019年3月末

【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 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	176,760	208,865	-	1.4	539,877	331,892
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	-	-	-	-	481,457	300,737
5 エクスポージャー変動推計モ デル	-	-	-	-	-	-
6 合計	-	-	-	-	-	632,629

【CCR2】CVAリスクに対する資本賦課

(単位 百万円)

	信用リスク 削減手法適 用後の エクスポ ージャー	リスク・ アセットの 額 (CVAリス ク相当額を 8%で除して 得た額)
1 先進的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	-	-
2 (i) CVAバリュー・アット・リスクの額(乗数適用後)	-	-
3 (ii) CVAストレステス・バリュー・アット・リスクの額(乗 数適用後)	-	-
4 標準的リスク測定方式の対象となるポートフォリオの合計	479,924	345,076
5 CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	479,924	345,076

【CCR3】業種別及びリスク・ウェイト別のカウンターパーティ信用リスク・エク
スポージャー

CCR3 その1 (単位 百万円)

業種	リスク・ウェイト	与信相当額(信用リスク削減効果勘案後)		
		0%	10%	20%
1 日本国政府及び日本銀行向け		2,970	-	-
2 外国の中央政府及び中央銀行向け		3,235	-	89
3 国際決済銀行等向け		16,662	-	-
4 我が国の地方公共団体向け		30	-	-
5 外国の中央政府等以外の公共部門 向け		-	-	50,167
6 国際開発銀行向け		17,302	-	-
7 地方公共団体金融機構向け		-	-	4,430
8 我が国の政府関係機関向け		-	2,592	7,988
9 地方三公社向け		-	-	-
10 金融機関及び第一種金融商品取引 業者向け		-	-	353,278
11 法人等向け		-	-	6,657
12 中小企業等向け及び個人向け		-	-	-
13 上記以外		-	-	-
14 合計		40,201	2,592	422,611

2018年3月末

(単位 百万円)

業種	リスク・ウェイト	与信相当額(信用リスク削減効果勘案後)		
		50%	75%	100%
1 日本国政府及び日本銀行向け		-	-	-
2 外国の中央政府及び中央銀行向け		-	-	-
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		524	-	-
6 国際開発銀行向け		-	-	-
7 地方公共団体金融機構向け		-	-	-
8 我が国の政府関係機関向け		-	-	-
9 地方三公社向け		-	-	-
10 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け		198	-	-
11 法人等向け		17,074	-	473,860
12 中小企業等向け及び個人向け		-	-	-
13 上記以外		-	-	-
14 合計		17,796	-	473,860

CCR3 その2

(単位 百万円)

業種	リスク・ウェイト	与信相当額(信用リスク削減効果勘案後)		
		150%	その他	合計
1 日本国政府及び日本銀行向け		-	-	1,948
2 外国の中央政府及び中央銀行向け		-	-	1,564
3 国際決済銀行等向け		-	-	3,606
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		-	-	49,512
6 国際開発銀行向け		-	-	5,183
7 地方公共団体金融機構向け		-	-	6,700
8 我が国の政府関係機関向け		-	-	5,897
9 地方三公社向け		-	-	-
10 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け		-	-	866,911
11 法人等向け		-	-	499,328
12 中小企業等向け及び個人向け		-	-	-
13 上記以外		-	-	-
14 合計		-	-	1,440,653

【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				レボ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)	13,275	170,599	35,054	204,316	2,289,853	3,796,491
2 現金(その他通貨)	67,469	30,294	-	18,210	4,361,124	3,706,506
3 国内ノンプリン債	10	19,175	-	7,372	2,489,471	2,074,812
4 その他ノンプリン債	598	-	-	-	3,380,530	3,194,129
5 政府関係機関債	3,490	-	-	-	793,573	1,166,549
6 社債	29,081	-	-	-	44,531	183,627
7 株式	16,030	-	53,507	26	775,906	449,301
8 その他担保	3,583	-	-	-	12,309	110,428
9 合計	133,535	220,068	88,562	229,925	14,147,298	14,681,844

(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。

2019年3月末

(単位 百万円)

業種	リスク・ウェイト	与信相当額(信用リスク削減効果勘案後)		
		50%	75%	100%
1 日本国政府及び日本銀行向け		-	-	-
2 外国の中央政府及び中央銀行向け		47	-	-
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		142	-	-
6 国際開発銀行向け		-	-	-
7 地方公共団体金融機構向け		-	-	-
8 我が国の政府関係機関向け		-	-	-
9 地方三公社向け		-	-	-
10 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け		354	-	-
11 法人等向け		15,617	-	539,766
12 中小企業等向け及び個人向け		-	-	-
13 上記以外		-	-	-
14 合計		16,162	-	539,766

CCR3 その2

(単位 百万円)

業種	リスク・ウェイト	与信相当額(信用リスク削減効果勘案後)		
		150%	その他	合計
1 日本国政府及び日本銀行向け		-	-	2,970
2 外国の中央政府及び中央銀行向け		-	-	3,372
3 国際決済銀行等向け		-	-	16,662
4 我が国の地方公共団体向け		-	-	30
5 外国の中央政府等以外の公共部門向け		-	-	50,309
6 国際開発銀行向け		-	-	17,302
7 地方公共団体金融機構向け		-	-	4,430
8 我が国の政府関係機関向け		-	-	10,581
9 地方三公社向け		-	-	-
10 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け		-	-	353,633
11 法人等向け		-	-	562,041
12 中小企業等向け及び個人向け		-	-	-
13 上記以外		-	-	-
14 合計		-	-	1,021,335

【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				レボ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)	6,582	140,069	77,963	180,323	2,878,249	2,215,507
2 現金(その他通貨)	68,920	27,682	2,089	18,941	4,905,460	4,340,753
3 国内ノンプリン債	9	20,998	-	7,413	1,396,726	1,472,726
4 その他ノンプリン債	566	-	-	-	3,555,600	3,441,955
5 政府関係機関債	2,692	-	-	-	899,756	1,509,405
6 社債	33,090	-	-	-	63,428	176,111
7 株式	7,444	683	41,497	-	569,099	272,473
8 その他担保	4,188	-	-	-	28,380	34,927
9 合計	123,494	189,433	121,549	206,678	14,296,703	13,463,860

(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。

2018年3月末

【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	709,819	893,030
2 インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ	724,289	658,238
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	1,434,109	1,551,269
公正価値		
7 プラスの公正価値(資産)	517	20,381
8 マイナスの公正価値(負債)	△19,078	△1,781

【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)		27,929
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。)	819,245	16,384
3 (i) 派生商品取引(上場以外)	562,055	11,241
4 (ii) 派生商品取引(上場)	112,763	2,255
5 (iii) レボ形式の取引	144,426	2,888
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	93,861	-
8 分別管理されていない当初証拠金	48,552	845
9 事前拠出された清算基金	38,435	10,698
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) レボ形式の取引	-	-
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
1	リート(合計)	-	-
2	担保付住宅ローン	-	-
3	クレジットカード債権	-	-
4	その他リート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	-	-

2019年3月末

【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	738,448	907,524
2 インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ	309,056	202,926
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	4,725	-
6 想定元本合計	1,052,229	1,110,451
公正価値		
7 プラスの公正価値(資産)	2,173	14,026
8 マイナスの公正価値(負債)	△14,223	△6,776

【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)		14,842
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。)	218,226	4,364
3 (i) 派生商品取引(上場以外)	87,289	1,745
4 (ii) 派生商品取引(上場)	27,854	557
5 (iii) レボ形式の取引	103,082	2,061
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	113,021	-
8 分別管理されていない当初証拠金	16,328	330
9 事前拠出された清算基金	48,173	10,146
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) レボ形式の取引	-	-
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
1	リート(合計)	-	-
2	担保付住宅ローン	-	-
3	クレジットカード債権	-	-
4	その他リート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	-	-

2018年3月末

	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	リート(合計)	-	-	-
2	担保付住宅ローン	-	-	-
3	クレジットカード債権	-	-	-
4	その他リート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	リート(合計)	121,027	-	121,027
2	担保付住宅ローン	59,695	-	59,695
3	クレジットカード債権	550	-	550
4	その他リートに係るエクスポージャー	60,781	-	60,781
5	再証券化	-	-	-
6	ホールセール(合計)	569,881	-	569,881
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	1,526	-	1,526
10	その他のホールセール	568,355	-	568,355
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	リート(合計)	-	-	-
2	担保付住宅ローン	-	-	-
3	クレジットカード債権	-	-	-
4	その他リートに係るエクスポージャー	-	-	-
5	再証券化	-	-	-
6	ホールセール(合計)	2,285	-	2,285
7	事業法人向けローン	2,285	-	2,285
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	-	-	-

2019年3月末

	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	リート(合計)	-	-	-
2	担保付住宅ローン	-	-	-
3	クレジットカード債権	-	-	-
4	その他リート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	リート(合計)	135,446	-	135,446
2	担保付住宅ローン	69,742	-	69,742
3	クレジットカード債権	-	-	-
4	その他リートに係るエクスポージャー	65,704	-	65,704
5	再証券化	-	-	-
6	ホールセール(合計)	571,360	-	571,360
7	事業法人向けローン	570,484	-	570,484
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	876	-	876
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	リート(合計)	-	-	-
2	担保付住宅ローン	-	-	-
3	クレジットカード債権	-	-	-
4	その他リート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)	1,843	-	1,843
7	事業法人向けローン	1,843	-	1,843
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	-	-	-

2018年3月末

	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)	228	-	228
2	担保付住宅ローン	228	-	228
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。

2019年3月末

	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)	4,096	-	4,096
2	担保付住宅ローン	108	-	108
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	3,988	-	3,988
5	再証券化	-	-	-
6	ホールセール(合計)	3,015	-	3,015
7	事業法人向けローン	3,015	-	3,015
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。

2018年3月末

【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				ホールセール
		譲渡型証券化取引(小計)	証券化			
			裏付けとなるリテール			
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)						
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	690,908	690,908	690,908	121,027	569,881
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	内部格付手法における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	-	-	-	-	-
7	内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
8	標準的手法が適用される証券化エクスポージャー	690,908	690,908	690,908	121,027	569,881
9	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により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	内部格付手法における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	-	-	-	-	-
11	内部格付手法における指定関数方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
12	標準的手法により算出した信用リスク・アセット	138,181	138,181	138,181	24,205	113,976
13	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により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	内部格付手法における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	-	-	-	-	-
15	内部格付手法における指定関数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	11,054	11,054	11,054	1,936	9,118
17	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により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	-	-	-	-	-

2019年3月末

【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				ホールセール
		譲渡型証券化取引(小計)	証券化			
			裏付けとなるリテール			
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)						
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	692,307	692,307	692,307	120,946	571,360
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	14,500	14,500	14,500	14,500	-
4	100%超1250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
5	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
エクスポージャーの額(算出方法別)						
6	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
7	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	706,807	706,807	706,807	135,446	571,360
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
9	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
信用リスク・アセットの額(算出方法別)						
10	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
11	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	145,587	145,587	145,587	31,359	114,228
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
13	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
所要自己資本の額(算出方法別)						
14	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-
15	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	11,647	11,647	11,647	2,508	9,138
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	-	-	-	-	-

2018年3月末

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		
		再証券化		証券化 取引 (小計)	証券化	
シニア	非シニア	取引 (小計)	証券化			
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	内部格付手法における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	-	-	-	-	-
7	内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
8	標準的手法が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
9	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により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	内部格付手法における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	-	-	-	-	-
11	内部格付手法における指定関数方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
12	標準的手法により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
13	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により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	内部格付手法における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	-	-	-	-	-
15	内部格付手法における指定関数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	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により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	-	-	-	-	-

2019年3月末

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		
		再証券化		証券化 取引 (小計)	証券化	
シニア	非シニア	取引 (小計)	証券化			
エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)						
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
2	20%超50%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
3	50%超100%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
4	100%超1250%未満のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
5	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
エクスポージャーの額(算出方法別)						
6	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
7	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
9	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
信用リスク・アセットの額(算出方法別)						
10	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
11	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
13	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
所要自己資本の額(算出方法別)						
14	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-
15	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-
16	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-
17	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-

2018年3月末

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	内部格付手法における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	-	-	-	-	-
7	内部格付手法における指定関数方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
8	標準的手法が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
9	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により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	内部格付手法における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	-	-	-	-	-
11	内部格付手法における指定関数方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
12	標準的手法により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
13	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により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	内部格付手法における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	-	-	-	-	-
15	内部格付手法における指定関数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	連結自己資本規制比率告示第二百二十五条第一項の規定により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	-	-	-	-	-

2019年3月末

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又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
7	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
8	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
9	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	-	-	-	-	-
信用リスク・アセットの額(算出方法別)						
10	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
11	外部格付準拠方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
12	標準的手法準拠方式により算出した信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
13	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る信用リスク・アセット	-	-	-	-	-
所要自己資本の額(算出方法別)						
14	内部格付手法準拠方式又は内部評価方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-
15	外部格付準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-
16	標準的手法準拠方式が適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-
17	1250%のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャーに係る所要自己資本	-	-	-	-	-

2018年3月末

【MR1】標準的方式によるマーケット・リスク相当額

(単位 百万円)

	リスク・アセット (リスク相当額を8パーセントで 除して得た額)
1	金利リスク(一般市場リスク及び個別リスク)の額
2	株式リスク(一般市場リスク及び個別リスク)の額
3	外国為替リスクの額
4	コモディティ・リスクの額
5	オプション取引
5	簡便法により算出した額
6	デルタ・プラス法により算出した額
7	シナリオ法により算出した額
8	証券化エクスポージャーに係る個別リスクの額
9	合計

2019年3月末

【MR1】標準的方式によるマーケット・リスク相当額

(単位 百万円)

	リスク・アセット (リスク相当額を8パーセントで 除して得た額)
1	金利リスク(一般市場リスク及び個別リスク)の額
2	株式リスク(一般市場リスク及び個別リスク)の額
3	外国為替リスクの額
4	コモディティ・リスクの額
5	オプション取引
5	簡便法により算出した額
6	デルタ・プラス法により算出した額
7	シナリオ法により算出した額
8	証券化エクスポージャーに係る個別リスクの額
9	合計

【MR2】内部モデル方式を適用して算出されたリスク・アセットの額の変動要因

(単位 百万円)

	前期末:2018年3月末 当期末:2019年3月末	バリュー・ アット・ リスク	ストレス・ バリュー・ アット・ リスク	追加的 リスク	包括的 リスク	その他	合計
1a	前期末におけるリスク・アセット	189,559	411,707	-	-		601,266
1b	前期末における連結自己資本規制上のリスク・アセット額への調整	5	3	-	-		4
1c	前期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	32,178	106,780	-	-		138,959
2	リスク量の変動	8,479	48,791	-	-		57,270
3	モデルの更新 又は変更	4,335	△13,492	-	-		△9,157
4	当期中の要因 別の変動額						
4	手法及び方針	-	-	-	-		-
5	買収及び売却	-	-	-	-		-
6	為替の変動	-	-	-	-		-
7	その他	-	-	-	-		-
8a	当期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	44,992	142,079	-	-		187,072
8b	当期末における連結自己資本規制上のリスク・アセット額への調整	3	3	-	-		3
8c	当期末におけるリスク・アセット	173,111	523,975	-	-		697,087

(単位 百万円)

	前四半期末:2018年12月末 当四半期末:2019年3月末	バリュー・ アット・ リスク	ストレス・ バリュー・ アット・ リスク	追加的 リスク	包括的 リスク	その他	合計
1a	前四半期末におけるリスク・アセット	176,487	310,714	-	-		487,201
1b	前四半期末における連結自己資本規制上のリスク・アセット額への調整	2	1	-	-		1
1c	前四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	64,703	196,079	-	-		260,782
2	リスク量の変動	△19,710	△53,999	-	-		△73,710
3	モデルの更新 又は変更	-	-	-	-		-
4	当四半期の要因 別の変動額						
4	手法及び方針	-	-	-	-		-
5	買収及び売却	-	-	-	-		-
6	為替の変動	-	-	-	-		-
7	その他	-	-	-	-		-
8a	当四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	44,992	142,079	-	-		187,072
8b	当四半期末における連結自己資本規制上のリスク・アセット額への調整	3	3	-	-		3
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	173,111	523,975	-	-		697,087

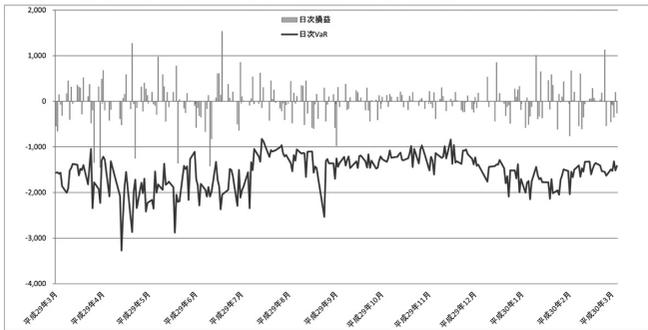
2018年3月末

【MR3】内部モデル方式の状況 (マーケット・リスク)

(単位 百万円)

バリュー・アット・リスク(保有期間 10営業日、片側信頼区間 99%)		
1	最大値	11,018
2	平均値	4,782
3	最小値	1,546
4	期末	2,574
ストレス・バリュー・アット・リスク(保有期間 10営業日、片側信頼区間 99%)		
5	最大値	21,025
6	平均値	9,448
7	最小値	3,930
8	期末	8,542
追加的リスクの額(片側信頼区間 99.9%)		
9	最大値	-
10	平均値	-
11	最小値	-
12	期末	-
包括的リスクの額(片側信頼区間 99.9%)		
13	最大値	-
14	平均値	-
15	最小値	-
16	期末	-
17	フロア(修正標準的方式)	-

【MR4】内部モデル方式のバック・テストの結果



【IRRBB1】金利リスク

(単位 百万円)

	△EVE	
	当期末	前期末
1	上方パラレルシフト	4,288
2	下方パラレルシフト	30,982
3	スティープ化	11,995
4	フラット化	520
5	短期金利上昇	1,563
6	短期金利低下	28,576
7	最大値	30,982
8	Tier1 資本の額	1,142,340

(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。

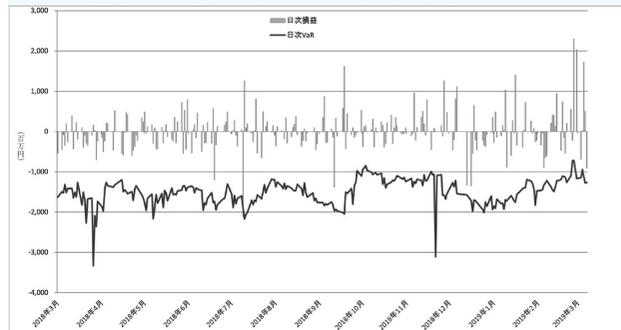
2019年3月末

【MR3】内部モデル方式の状況 (マーケット・リスク)

(単位 百万円)

バリュー・アット・リスク(保有期間 10営業日、片側信頼区間 99%)		
1	最大値	15,076
2	平均値	5,850
3	最小値	1,932
4	期末	3,969
ストレス・バリュー・アット・リスク(保有期間 10営業日、片側信頼区間 99%)		
5	最大値	18,297
6	平均値	10,498
7	最小値	4,635
8	期末	12,092
追加的リスクの額(片側信頼区間 99.9%)		
9	最大値	-
10	平均値	-
11	最小値	-
12	期末	-
包括的リスクの額(片側信頼区間 99.9%)		
13	最大値	-
14	平均値	-
15	最小値	-
16	期末	-
17	フロア(修正標準的方式)	-

【MR4】内部モデル方式のバック・テストの結果



【IRRBB1】金利リスク

(単位 百万円)

	△EVE	
	2019年3月末	2018年3月末
1	上方パラレルシフト	4,288
2	下方パラレルシフト	30,982
3	スティープ化	11,995
4	フラット化	520
5	短期金利上昇	1,563
6	短期金利低下	28,576
7	最大値	30,982
8	Tier1 資本の額	1,142,340

(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。

2018年3月末

2019年3月末

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

(単位 百万円)

国又は地域	各金融当局が定める比率	カウンター・シクリカル・バッファー比率の計算に用いた当該国又は地域に係る信用リスク・アセットの額	カウンター・シクリカル・バッファー比率	カウンター・シクリカル・バッファーの額
香港	2.50%	10,069		
スウェーデン	2.00%	1,271		
英国	1.00%	24,383		
小計		35,724		
合計		1,778,639	0.02%	355

(注)「カウンター・シクリカル・バッファー比率の計算に用いた当該国又は地域に係る信用リスク・アセットの額」については原則最終リスクベースでの算出を行っていますが、一部最終リスク国の把握が実態的に困難な資産については、記帳地を用いて算出を行っています。

2018年3月末

1. 連結レバレッジ比率の構成に関する開示

(単位 百万円, %)

国際様式 (表2)の 該当番号	国際様式 (表1)の 該当番号	項目	2018年 3月末
オン・バランス資産の額 (1)			
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	11,659,677
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	21,141,743
1b	2	連結レバレッジ比率の範囲に含まれない子法人等の資産の額(△)	-
1c	7	連結レバレッジ比率の範囲に含まれる子会社の資産の額(連結貸借対照表における総資産の額に含まれる額を除く。)	-
1d	3	連結貸借対照表における総資産の額から控除される調整項目以外の資産の額(△)	9,482,066
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	115,303
3		オン・バランス資産の額 (イ)	11,544,374
デリバティブ取引等に関する額 (2)			
4		デリバティブ取引等に関する再構築コストの額	432,448
5		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	1,310,291
		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた証拠金の対価の額	264,892
6		連結貸借対照表から控除されているデリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた証拠金の対価の額	-
7		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた変動証拠金の対価の額のうち控除する額(△)	118,441
8		清算会員である最終指定親会社等が補償を義務付けられていない顧客とのトレード・エクスポージャーの額(△)	
9		クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額	1,551,276
10		クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額から控除した額(△)	1,253,152
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	2,187,314
レボ取引等に関する額 (3)			
12		レボ取引等に関する資産の額	7,517,198
13		レボ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	1,156,495
14		レボ取引等に関するカウンターパーティ・リスクのエクスポージャーの額	211,873
15		代理取引のエクスポージャーの額	
16	5	レボ取引等に関する額 (ハ)	6,572,576
オフ・バランス取引に関する額 (4)			
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	80,259
18		オフ・バランス取引に係るエクスポージャーの額への変換調整の額(△)	26,485
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	53,774
連結レバレッジ比率 (5)			
20		資本の額 (ホ)	1,142,340
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	20,358,038
22		連結レバレッジ比率(ホ)/(ヘ))	5.61%

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。

2019年3月末

1. 連結レバレッジ比率の構成に関する開示

(単位 百万円, %)

国際様式 (表2)の 該当番号	国際様式 (表1)の 該当番号	項目	2019年 3月末	2018年 3月末
オン・バランス資産の額 (1)				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	12,041,187	11,659,677
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	21,126,706	21,141,743
1b	2	連結レバレッジ比率の範囲に含まれない子法人等の資産の額(△)	-	-
1c	7	連結レバレッジ比率の範囲に含まれる子会社の資産の額(連結貸借対照表における総資産の額に含まれる額を除く。)	-	-
1d	3	連結貸借対照表における総資産の額から控除される調整項目以外の資産の額(△)	9,085,519	9,482,066
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	146,287	115,303
3		オン・バランス資産の額 (イ)	11,894,900	11,544,374
デリバティブ取引等に関する額 (2)				
4		デリバティブ取引等に関するRCの額に1.4を乗じた額	489,419	-
		デリバティブ取引等に関する再構築コストの額	-	432,448
5		デリバティブ取引等に関するPFEの額に1.4を乗じた額	395,086	-
		デリバティブ取引等に関するアドオンの額	-	1,310,291
		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた証拠金の対価の額	-	264,892
6		連結貸借対照表から控除されているデリバティブ取引等に関連して差し入れた担保の対価の額	-	-
		連結貸借対照表から控除されているデリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた変動証拠金の対価の額	-	-
7		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた変動証拠金の対価の額のうち控除する額(△)	106,899	118,441
8		清算会員である最終指定親会社等が補償を義務付けられていない顧客とのトレード・エクスポージャーの額(△)		
9		クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額	1,110,451	1,551,276
10		クレジット・デリバティブのプロテクションを提供した場合における調整後想定元本の額から控除した額(△)	830,277	1,253,152
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	1,057,780	2,187,314
レボ取引等に関する額 (3)				
12		レボ取引等に関する資産の額	6,540,957	7,517,198
13		レボ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	668,826	1,156,495
14		レボ取引等に関するカウンターパーティ・リスクのエクスポージャーの額	163,474	211,873
15		代理取引のエクスポージャーの額		
16	5	レボ取引等に関する額 (ハ)	6,035,605	6,572,576
オフ・バランス取引に関する額 (4)				
17		オフ・バランス取引の想定元本の額	122,854	80,259
18		オフ・バランス取引に係るエクスポージャーの額への変換調整の額(△)	43,528	26,485
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	79,326	53,774
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	1,092,835	1,142,340
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	19,067,611	20,358,038
22		連結レバレッジ比率(ホ)/(ヘ))	5.73%	5.61%

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。

2018年3月末

自己資本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
規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	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	
	連結自己資本規制比率	1,185,256百万円
9	額面総額	—
表示される科目の区分		
10	連結貸借対照表	株主資本
11	発行日	—
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	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	—
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	—
剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別	変動
18	配当率又は利率	—
19	配当等停止条項の有無	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	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	—
25	転換の範囲	—
26	転換の比率	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無	—
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	無
31	元本の削減が生じる場合	—
32	元本の削減が生じる範囲	—
33	元本回復特約の有無	—
34	その概要	—
35	残余財産の分配又は倒産手続き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のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無
37	非充足資本要件の内容	—

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
規制上の取り扱い			
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	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		
	連結自己資本規制比率	182百万円	228百万円

2019年3月末

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	
規制上の取り扱い			
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。)	(1)	—
	規制上の取り扱い	(2)	—
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	(3)	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類		普通株式
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額	(4)	
	連結自己資本規制比率		1,182,379百万円
9	額面総額	(5)	—
表示される科目の区分			
10	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き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	非充足資本要件の有無	(25)	無
37	非充足資本要件の内容	(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
規制上の取り扱い			
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。)	(1)	—
	規制上の取り扱い	(2)	—
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	(3)	大和証券グループ本社
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

2018年3月末

9	額面総額	-	-
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2006年7月1日	2007年7月1日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2026年6月30日	2027年6月30日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-	-
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	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別	変動	変動
18	配当率又は利率	-	-
19	配当等停止条項の有無	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	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	-	-
25	転換の範囲	-	-
26	転換の比率	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-	-
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	無	無
31	元本の削減が生じる場合	-	-
32	元本の削減が生じる範囲	-	-
33	元本回復特約の有無	-	-
34	その概要	-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続き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のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	-	-

2019年3月末

8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額	(4)	162百万円	209百万円
	連結自己資本規制比率			
9	額面総額	(5)	-	-
10	表示される科目の区分	(6)		
	連結貸借対照表		新株予約権	新株予約権
11	発行日	(7)	2006年7月1日	2007年7月1日
12	償還期限の有無		有	有
13	その日付		2026年6月30日	2027年6月30日
14	償還等を可能とする特約の有無		無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	(8)	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	(9)	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	(10)	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払			
17	配当率又は利率の種別	(11)	変動	変動
18	配当率又は利率	(12)	-	-
19	配当等停止条項の有無	(13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	(14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無		無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無		無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無		無	無
24	転換が生じる場合	(15)	-	-
25	転換の範囲	(16)	-	-
26	転換の比率	(17)	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	(18)	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類		-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者		-	-
30	元本の削減に係る特約の有無	(19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合	(20)	-	-
32	元本の削減が生じる範囲	(21)	-	-
33	元本回復特約の有無	(22)	-	-
34	その概要		-	-
34a	劣後性の手段	(23)	-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	(24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無	(25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容	(25)	-	-

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	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	第5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		
	連結自己資本規制比率	213百万円	632百万円
9	額面総額	-	-
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2008年7月1日	2008年9月8日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2028年6月30日	2018年6月20日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-	-

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社	
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無	
3	準拠法	国内法	国内法	
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。)	(1)	-	-
	規制上の取り扱い	(2)		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	(3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類		2008年7月発行新株予約権	2009年7月発行新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額	(4)		
	連結自己資本規制比率		196百万円	261百万円
9	額面総額	(5)	-	-
10	表示される科目の区分	(6)		
	連結貸借対照表		新株予約権	新株予約権
11	発行日	(7)	2008年7月1日	2009年7月1日
12	償還期限の有無		有	有
13	その日付		2028年6月30日	2029年6月30日
14	償還等を可能とする特約の有無		無	無

2018年3月末

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	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別	変動	変動
18	配当率又は利率	-	-
19	配当等停止条項の有無	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	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	-	-
25	転換の範囲	-	-
26	転換の比率	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-	-
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	無	無
31	元本の削減が生じる場合	-	-
32	元本の削減が生じる範囲	-	-
33	元本回復特約の有無	-	-
34	その概要	-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続き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のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	-	-

2019年3月末

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きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	-	-

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	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	2009年7月発行新株予約権	第6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		
	連結自己資本規制比率	283百万円	249百万円
9	額面総額	-	-
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2009年7月1日	2009年11月9日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2029年6月30日	2019年6月19日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-	-
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	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別	変動	変動
18	配当率又は利率	-	-
19	配当等停止条項の有無	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	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

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
	外国法に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。)	(1)	-
3a	規制上の取り扱い	(2)	-
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	第6回新株予約権	2010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		
	連結自己資本規制比率 (4)	210百万円	307百万円
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)	2009年11月9日	2010年7月1日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2019年6月19日	2030年6月30日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	-	-
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量

2018年3月末

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	-	-
25	転換の範囲	-	-
26	転換の比率	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-	-
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	無	無
31	元本の削減が生じる場合	-	-
32	元本の削減が生じる範囲	-	-
33	元本回復特約の有無	-	-
34	その概要	-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続き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のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	-	-

2019年3月末

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
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	劣後性手段	(23)	-
35	残余財産の分配又は倒産手続き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	非充足資本要件の有無	(25)	無
37	非充足資本要件の内容	(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
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2010年7月発行新株予約権	第7回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	331百万円	243百万円
9	額面総額	-	-
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2010年7月1日	2010年9月1日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2030年6月30日	2020年6月25日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-	-
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	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別	変動	変動
18	配当率又は利率	-	-
19	配当等停止条項の有無	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	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	-	-
25	転換の範囲	-	-
26	転換の比率	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-	-
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	-	-

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
	規制上の取り扱い		
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。)	(1)	-
	規制上の取り扱い	(2)	-
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	(3)	大和証券グループ本社 大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	第7回新株予約権	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		
	連結自己資本規制比率	(4)	215百万円 370百万円
9	額面総額	(5)	-
10	表示される科目の区分	(6)	
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	(7)	2010年9月1日 2011年7月1日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2020年6月25日	2031年6月30日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	(8)	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	(9)	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	(10)	-
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別	(11)	変動 変動
18	配当率又は利率	(12)	-
19	配当等停止条項の有無	(13)	無
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	-	-

2018年3月末

30	元本の削減に係る特約の有無	無	無
31	元本の削減が生じる場合	—	—
32	元本の削減が生じる範囲	—	—
33	元本回復特約の有無	—	—
34	その概要	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続き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のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	—	—

2019年3月末

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き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	非充足資本要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本要件の内容 (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
規制上の取り扱い			
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2011年7月発行新株予約権	第8回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	390百万円	245百万円
9	額面総額	—	—
表示される科目の区分			
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2011年7月1日	2011年9月5日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2031年6月30日	2021年6月24日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	—	—
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	—	—
剰余金の配当又は利息の支払			
17	配当率又は利率の種別	変動	変動
18	配当率又は利率	—	—
19	配当等停止条項の有無	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	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	—	—
25	転換の範囲	—	—
26	転換の比率	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無	—	—
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	無	無
31	元本の削減が生じる場合	—	—
32	元本の削減が生じる範囲	—	—
33	元本回復特約の有無	—	—
34	その概要	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続き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のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	—	—

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
規制上の取り扱い			
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)	(1)
	規制上の取り扱い	(2)	(2)
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	第8回新株予約権	2013年2月発行新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	218百万円	419百万円
9	額面総額 (5)	—	—
表示される科目の区分 (6)			
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2011年9月5日	2013年2月12日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2021年6月24日	2032年6月30日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
剰余金の配当又は利息の支払			
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性的手段 (23)	—	—

2018年3月末

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
	規制上の取り扱い		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2013年2月発行新株予約権	第9回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	445百万円	1,004百万円
9	額面総額	-	-
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2013年2月12日	2013年2月12日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2032年6月30日	2022年6月26日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-	-
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	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別	変動	変動
18	配当率又は利率	-	-
19	配当等停止条項の有無	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	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	-	-
25	転換の範囲	-	-
26	転換の比率	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-	-
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	無	無
31	元本の削減が生じる場合	-	-
32	元本の削減が生じる範囲	-	-
33	元本回復特約の有無	-	-
34	その概要	-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続き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のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	-	-

2019年3月末

35	残余財産の分配又は倒産手続き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	非充足資本要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本要件の内容 (25)	-	-

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。)(1)	-	-
	規制上の取り扱い(2)		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	第9回新株予約権	2014年2月発行新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)		
	連結自己資本規制比率	975百万円	358百万円
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	有	有
13	その日付	2022年6月26日	2033年6月30日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別(11)	変動	変動
18	配当率又は利率(12)	-	-
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合(15)	-	-
25	転換の範囲(16)	-	-
26	転換の比率(17)	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無(18)	-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	-	-
30	元本の削減に係る特約の有無(19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合(20)	-	-
32	元本の削減が生じる範囲(21)	-	-
33	元本回復特約の有無(22)	-	-
34	その概要	-	-
34a	劣後性の手段(23)	-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続き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	非充足資本要件の有無(25)	無	無
37	非充足資本要件の内容(25)	-	-

2018年3月末

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
規制上の取り扱い			
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2014年2月発行新株予約権	第10回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	368百万円	1,105百万円
9	額面総額	-	-
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2014年2月10日	2014年2月10日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2033年6月30日	2023年6月25日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-	-
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	-	-
剰余金の配当又は利息の支払			
17	配当率又は利率の種別	変動	変動
18	配当率又は利率	-	-
19	配当等停止条項の有無	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	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	-	-
25	転換の範囲	-	-
26	転換の比率	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-	-
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	無	無
31	元本の削減が生じる場合	-	-
32	元本の削減が生じる範囲	-	-
33	元本回復特約の有無	-	-
34	その概要	-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続き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のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	-	-

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
規制上の取り扱い			
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額

2019年3月末

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
規制上の取り扱い			
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)	(1)
	規制上の取り扱い	(2)	(2)
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	第10回新株予約権	2015年2月発行新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	1,157百万円	375百万円
9	額面総額	(5)	(5)
10	表示される科目の区分	(6)	(6)
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	(7)	(7)
		2014年2月10日	2015年2月9日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2023年6月25日	2034年6月30日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	(8)	(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)	(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)	(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)	(11)
		変動	変動
18	配当率又は利率	(12)	(12)
		-	-
19	配当等停止条項の有無	(13)	(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)	(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	(15)	(15)
		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	(16)	(16)
		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	(17)	(17)
		無	無
24	転換が生じる場合	(18)	(18)
		-	-
25	転換の範囲	(19)	(19)
		-	-
26	転換の比率	(20)	(20)
		-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	(21)	(21)
		-	-
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	(22)	(22)
		-	-
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	(23)	(23)
		-	-
30	元本の削減に係る特約の有無	(24)	(24)
		無	無
31	元本の削減が生じる場合	(25)	(25)
		-	-
32	元本の削減が生じる範囲	(26)	(26)
		-	-
33	元本回復特約の有無	(27)	(27)
		-	-
34	その概要	(28)	(28)
		-	-
34a	劣後性の手段	(29)	(29)
		-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続き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	(30)	(30)
		一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	(31)	(31)
		無	無
37	非充足資本要件の内容	(32)	(32)
		-	-

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
規制上の取り扱い			
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)	(1)
	規制上の取り扱い	(2)	(2)
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額

2018年3月末

5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2015年2月発行新株予約権	第11回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	384百万円	733百万円
9	額面総額	-	-
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2015年2月9日	2015年2月9日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2034年6月30日	2024年6月25日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-	-
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	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別	変動	変動
18	配当率又は利率	-	-
19	配当等停止条項の有無	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	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	-	-
25	転換の範囲	-	-
26	転換の比率	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-	-
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	無	無
31	元本の削減が生じる場合	-	-
32	元本の削減が生じる範囲	-	-
33	元本回復特約の有無	-	-
34	その概要	-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続き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のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	-	-

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
	規制上の取扱い		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2016年2月発行新株予約権	第12回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	383百万円	249百万円
9	額面総額	-	-
10	表示される科目の区分		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2016年2月16日	2016年2月16日
12	償還期限の有無	有	有

2019年3月末

5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社 (3)	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	第11回新株予約権	2016年2月発行新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	954百万円	376百万円
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
12	償還期限の有無		有
13	その日付		2024年6月25日
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	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きにおける債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	-	-

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。)	(1)	-
	規制上の取扱い (2)		
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	第12回新株予約権	2017年2月発行新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	357百万円	404百万円
9	額面総額 (5)	-	-

2018年3月末

13	その日付	2035年6月30日	2025年6月24日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	—	—
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	—	—
剰余金の配当又は利息の支払			
17	配当率又は利率の種別	変動	変動
18	配当率又は利率	—	—
19	配当等停止条項の有無	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	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	—	—
25	転換の範囲	—	—
26	転換の比率	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無	—	—
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	無	無
31	元本の削減が生じる場合	—	—
32	元本の削減が生じる範囲	—	—
33	元本回復特約の有無	—	—
34	その概要	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続き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のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	—	—

2019年3月末

10	表示される科目の区分	(6)	新株予約権	新株予約権
連結貸借対照表				
11	発行日	(7)	2016年2月16日	2017年2月8日
12	償還期限の有無		有	有
13	その日付		2025年6月24日	2036年6月30日
14	償還等を可能とする特約の有無		無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	(8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	(9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要	(10)	—	—
剰余金の配当又は利息の支払				
17	配当率又は利率の種別	(11)	変動	変動
18	配当率又は利率	(12)	—	—
19	配当等停止条項の有無	(13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無	(14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無		無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無		無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無		無	無
24	転換が生じる場合	(15)	—	—
25	転換の範囲	(16)	—	—
26	転換の比率	(17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無	(18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類		—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者		—	—
30	元本の削減に係る特約の有無	(19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合	(20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲	(21)	—	—
33	元本回復特約の有無	(22)	—	—
34	その概要		—	—
34a	劣後性の手段	(23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続き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	非充足資本要件の有無	(25)	無	無
37	非充足資本要件の内容	(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
規制上の取り扱い			
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	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		
	連結自己資本規制比率	404百万円	240百万円
9	額面総額	—	—
表示される科目の区分			
連結貸借対照表		新株予約権	新株予約権
11	発行日	2017年2月8日	2017年2月8日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2036年6月30日	2026年6月27日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	—	—
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	—	—
剰余金の配当又は利息の支払			
17	配当率又は利率の種別	変動	変動

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
規制上の取り扱い			
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)	—
		(2)	—
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	(3)	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	第13回新株予約権	2018年2月発行新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額	(4)	
	連結自己資本規制比率	432百万円	435百万円
9	額面総額	(5)	—
表示される科目の区分			
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
12	償還期限の有無		有
13	その日付		2026年6月27日
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)	—

2018年3月末

18	配当率又は利率	-	-
19	配当等停止条項の有無	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	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	-	-
25	転換の範囲	-	-
26	転換の比率	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-	-
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	無	無
31	元本の削減が生じる場合	-	-
32	元本の削減が生じる範囲	-	-
33	元本回復特約の有無	-	-
34	その概要	-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続き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のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	-	-

2019年3月末

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き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	非充足資本要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本要件の内容 (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
	規制上の取り扱い	-	-
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	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	-	-
	連結自己資本規制比率	435百万円	34百万円
9	額面総額	-	-
10	表示される科目の区分	-	-
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日	2018年2月8日	2018年2月8日
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2037年6月30日	2027年6月27日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	-	-
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	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払	-	-
17	配当率又は利率の種別	変動	変動
18	配当率又は利率	-	-
19	配当等停止条項の有無	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	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

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
	規制上の取り扱い	-	-
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。)	(1)	-
	規制上の取り扱い	(2)	-
4	平成三十四年三月三十日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	平成三十四年三月三十一日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	(3)	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	第14回新株予約権	第15回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額	(4)	-
	連結自己資本規制比率	238百万円	105百万円
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
12	償還期限の有無	有	有
13	その日付	2027年6月27日	2028年6月26日
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	-	-
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	-	-
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	-	-
	剰余金の配当又は利息の支払	-	-
17	配当率又は利率の種別 (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

2018年3月末

24	転換が生じる場合	-	-
25	転換の範囲	-	-
26	転換の比率	-	-
27	転換に係る発行者の裁量の有無	-	-
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	無	無
31	元本の削減が生じる場合	-	-
32	元本の削減が生じる範囲	-	-
33	元本回復特約の有無	-	-
34	その概要	-	-
35	残余財産の分配又は倒産手続き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のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	一般債務	一般債務
36	非充足資本要件の有無	無	無
37	非充足資本要件の内容	-	-

2019年3月末

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き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)	-	-

2018年3月末

連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

項目		(単位：百万円、%、件)	
適格流動資産		当最終指定親会社四半期	
1	適格流動資産の合計額	2,687,674	
資金流出額		(2)	
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	1,808,090	180,809
3	うち、安定預金の額	-	-
4	うち、準安定預金の額	1,808,090	180,809
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,455,439	1,437,045
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	-	-
7	うち、適格オペレーショナル預金及び負債性有価証券以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額	2,380,519	1,362,125
8	うち、負債性有価証券の額	74,919	74,919
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	6,438,264	419,051
10	デリバティブ取引等、資金調達プログラム及び与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	228,464	228,464
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	217,954	217,954
12	うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	-	-
13	うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	10,510	10,510
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	3,848,840	1,328,920
15	偶発事象に係る資金流出額	150,725	150,307
16	資金流出合計額	3,744,602	
資金流入額		(3)	
17	有担保資金運用等に係る資金流入額	6,037,256	170,172
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	408,081	406,668
19	その他資金流入額	3,587,632	1,334,882
20	資金流入合計額	1,911,723	
連結流動性カバレッジ比率		(4)	
21	算入可能適格流動資産の合計額	2,687,674	
22	純資金流出額	1,832,879	
23	連結流動性カバレッジ比率	146.6%	
24	平均値計算用データ数	59件	

項目		(単位：百万円、%、件)	
適格流動資産		前最終指定親会社四半期	
1	適格流動資産の合計額	2,532,823	
資金流出額		(2)	
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	1,740,436	174,043
3	うち、安定預金の額	-	-
4	うち、準安定預金の額	1,740,436	174,043
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,316,960	1,299,461
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	-	-
7	うち、適格オペレーショナル預金及び負債性有価証券以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額	2,259,509	1,242,009
8	うち、負債性有価証券の額	57,451	57,451
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	6,664,430	414,602
10	デリバティブ取引等、資金調達プログラム及び与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	223,100	223,100
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	212,854	212,854
12	うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	-	-
13	うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	10,246	10,246
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	3,732,993	1,295,677
15	偶発事象に係る資金流出額	146,440	145,826
16	資金流出合計額	3,552,712	
資金流入額		(3)	
17	有担保資金運用等に係る資金流入額	5,586,882	156,558
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	429,979	428,649
19	その他資金流入額	3,490,344	1,267,433
20	資金流入合計額	1,852,641	
連結流動性カバレッジ比率		(4)	
21	算入可能適格流動資産の合計額	2,532,823	
22	純資金流出額	1,700,070	
23	連結流動性カバレッジ比率	148.9%	
24	平均値計算用データ数	62件	

2019年3月末

連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

項目		(単位：百万円、%、件)	
適格流動資産		当最終指定親会社四半期	
1	適格流動資産の合計額	2,528,417	
資金流出額		(2)	
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	1,757,279	175,727
3	うち、安定預金の額	-	-
4	うち、準安定預金の額	1,757,279	175,727
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,646,411	1,545,852
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	-	-
7	うち、適格オペレーショナル預金及び負債性有価証券以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額	2,581,951	1,481,392
8	うち、負債性有価証券の額	64,460	64,460
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	6,799,261	433,523
10	デリバティブ取引等、資金調達プログラム及び与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	226,236	226,236
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	215,618	215,618
12	うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	-	-
13	うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	10,618	10,618
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	4,095,100	1,072,910
15	偶発事象に係る資金流出額	86,791	86,405
16	資金流出合計額	3,540,657	
資金流入額		(3)	
17	有担保資金運用等に係る資金流入額	5,451,550	188,070
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	502,341	408,594
19	その他資金流入額	3,828,179	1,157,918
20	資金流入合計額	1,754,582	
連結流動性カバレッジ比率		(4)	
21	算入可能適格流動資産の合計額	2,528,417	
22	純資金流出額	1,786,074	
23	連結流動性カバレッジ比率	141.5%	
24	平均値計算用データ数	58件	

項目		(単位：百万円、%、件)	
適格流動資産		前最終指定親会社四半期	
1	適格流動資産の合計額	2,501,861	
資金流出額		(2)	
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	1,791,902	179,190
3	うち、安定預金の額	-	-
4	うち、準安定預金の額	1,791,902	179,190
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,393,304	1,276,488
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	-	-
7	うち、適格オペレーショナル預金及び負債性有価証券以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額	2,328,102	1,211,285
8	うち、負債性有価証券の額	65,202	65,202
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	7,327,300	416,314
10	デリバティブ取引等、資金調達プログラム及び与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	265,317	265,317
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	254,782	254,782
12	うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	-	-
13	うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	10,535	10,535
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	4,357,483	1,202,602
15	偶発事象に係る資金流出額	174,789	174,399
16	資金流出合計額	3,514,313	
資金流入額		(3)	
17	有担保資金運用等に係る資金流入額	5,949,504	155,634
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	376,708	353,289
19	その他資金流入額	3,980,981	1,197,075
20	資金流入合計額	1,705,999	
連結流動性カバレッジ比率		(4)	
21	算入可能適格流動資産の合計額	2,501,861	
22	純資金流出額	1,808,314	
23	連結流動性カバレッジ比率	138.3%	
24	平均値計算用データ数	62件	

2018年3月末

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号		2018年 3月末	2017年 12月末	2017年 9月末	2017年 6月末	2017年 3月末
連結流動性カバレッジ比率						
15	算入可能適格流動性 資産の合計額	2,687,674	2,532,823	2,627,529	2,499,543	2,365,828
16	純資金流出額	1,832,879	1,700,070	1,808,991	1,714,293	1,627,730
17	連結流動性カバレ ッジ比率	146.6%	148.9%	145.2%	145.8%	145.3%

連結流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項

1. 時系列における連結流動性カバレッジ比率の変動に関する事項

当最終指定親会社四半期の適格流動資産の合計額は前最終指定親会社四半期比1,548億51百万円増の2兆6,876億74百万円となりました。ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額が同1,375億84百万円増の1兆4,370億45百万円、資金提供義務等に基づく資金流出額が同332億43百万円増の1兆3,289億20百万円、その他資金流入額が同674億49百万円増の1兆3,348億82百万円となり、純資金流出額は同1,328億09百万円増の1兆8,328億79百万円となりました。

その結果、連結流動性カバレッジ比率は同2.3ポイント減の146.6%となり、2015年度第1四半期以降、概ね安定的に推移しております。

2. 連結流動性カバレッジ比率の水準の評価に関する事項

当社グループでは、「規制流動性管理規程」を定め、法令上の最低水準を上回る水準を確保するだけでなく、社内の警戒水準を設定して十分な水準が確保されているかを定期的に評価しております。

当社グループの連結流動性カバレッジ比率は、法令上の最低水準を十分に上回っております。

3. 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項

内容に関する著しい変動はありません。

4. その他連結流動性カバレッジ比率に関する事項

当最終指定親会社四半期から主要な指標につき過去5四半期の推移を開示しております。

連結流動性リスク管理に係る開示事項

1. 流動性に係るリスク管理の方針及び手続の概要に関する事項

当社グループは、ビジネスを継続する上で十分な流動性を効率的かつ安定的に確保することを資金調達の基本方針としております。資金部は当社グループの資金繰りを所管する部署として、環境が大きく変動した場合においても業務の継続に支障をきたすことのないよう、平時から安定的に資金を確保するよう努めています。

リスクマネジメント部は、流動性リスクを所管する部署として、短期及び長期の流動性管理指標を用いて、流動性リスクの状況をモニタリングし、日次で経営陣に報告しています。当該指標は、取締役会において、リスクアパタイト指標として設定し、定期的にその遵守状況を確認しております。

また、当社グループは、流動性リスクの状況を的確に把握し、適切な流動性リスク管理体制の整備・確立に努めておりますが、流動性リスクが顕在化した際に適切に対応できるよう、コンティンジェンシー・ファンディング・プランを策定しております。

2019年3月末

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号		2019年 3月末	2018年 12月末	2018年 9月末	2018年 6月末	2018年 3月末
連結流動性カバレッジ比率						
15	算入可能適格流動性 資産の合計額	2,528,417	2,501,861	2,675,608	2,688,055	2,687,674
16	純資金流出額	1,786,074	1,808,314	1,883,117	1,896,228	1,832,879
17	連結流動性カバレ ッジ比率	141.5%	138.3%	142.0%	141.7%	146.6%

連結流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項

1. 時系列における連結流動性カバレッジ比率の変動に関する事項

当最終指定親会社四半期の適格流動資産の合計額は前最終指定親会社四半期比265億56百万円増の2兆5,284億17百万円となりました。ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額が同2,693億64百万円増の1兆5,458億52百万円、資金提供義務等に基づく資金流出額が同1,296億92百万円減の1兆729億10百万円、その他資金流入額が同391億57百万円減の1兆1,579億18百万円となり、純資金流出額は同222億40百万円減の1兆7,860億74百万円となりました。

その結果、連結流動性カバレッジ比率は同3.2%増の141.5%となり、2015年度第1四半期以降、概ね安定的に推移しております。

2. 連結流動性カバレッジ比率の水準の評価に関する事項

当社グループでは、「規制流動性管理規程」を定め、法令上の最低水準を上回る水準を確保するだけでなく、社内の警戒水準を設定して十分な水準が確保されているかを定期的に評価しております。

当社グループの連結流動性カバレッジ比率は、法令上の最低水準を十分に上回っております。

3. 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項

内容に関する著しい変動はありません。

4. その他連結流動性カバレッジ比率に関する事項

その他偶発事象に係る資金流出額に係るファンド出資枠に対する追加出資(キャピタル・コール)および自社債の買戻しについて算出方法を改定しております。当最終指定親会社四半期での影響額は1,005億円の減少となります。

連結流動性リスク管理に係る開示事項

1. 流動性に係るリスク管理の方針及び手続の概要に関する事項

当社グループは、ビジネスを継続する上で十分な流動性を効率的かつ安定的に確保することを資金調達の基本方針としております。資金部は当社グループの資金繰りを所管する部署として、環境が大きく変動した場合においても業務の継続に支障をきたすことのないよう、平時から安定的に資金を確保するよう努めています。

リスクマネジメント部は、流動性リスクを所管する部署として、短期及び長期の流動性管理指標を用いて、流動性リスクの状況をモニタリングし、日次で経営陣に報告しています。当該指標は、取締役会において、リスクアパタイト指標として設定し、定期的にその遵守状況を確認しております。

また、当社グループは、流動性リスクの状況を的確に把握し、適切な流動性リスク管理体制の整備・確立に努めておりますが、流動性リスクが顕在化した際に適切に対応できるよう、コンティンジェンシー・ファンディング・プランを策定しております。

2018年3月末

2. 流動性に係るリスク管理上の指標及びその他流動性に係るリスク管理に関する事項

(1) リスクアベタイト指標

短期指標としての流動性ギャップと長期指標としての長期性資金レシオを流動性に係るリスクアベタイト指標として設定し、管理・モニタリングを行っております。

なお、短期指標の見直しに伴い、2018年度より連結流動性カバレッジ比率に変更しております。

流動性ギャップ

当社グループに適用される規制上の連結流動性カバレッジ比率を遵守するため、流動性ギャップを設定しております。流動性ギャップは、ストレス時においても最低90日以上業務を継続できるよう、資金化可能な流動性資産の十分性を確認するための指標です。連結流動性カバレッジ比率よりも業務を継続するための期間を長く設定することで、より安定的な流動性リスク管理体制を目指しています。また、全通貨合算では1年、外貨全体では期間を30日として流動性確保状況をモニタリングしております。

長期性資金レシオ

長期性資金の十分性を検証するための指標として長期性資金レシオを設定・管理・モニタリングし、1年以上の長期間に亘りストレス環境が継続した場合においても業務を継続するための態勢を確認しております。

(2) コンティンジェンシー・ファンディング・プラン

当社グループは、流動性リスクが顕在化した場合には金融機関の経営破綻に直結するおそれがあることを認識しており、流動性危機時に適切に対応するため、コンティンジェンシー・ファンディング・プランを策定しております。同プランは、信用力の低下等の内生的要因や金融市場の混乱等の外生的要因によるストレスの逼迫度に応じた報告体制や資金調達手段の確保などの方針を定めております。また、早期警戒指標(EWI)を設けて、当社グループの流動性に関する状況をモニタリングしております。これにより当社グループは機動的に流動性を確保する態勢を整備しております。

2019年3月末

2. 流動性に係るリスク管理上の指標及びその他流動性に係るリスク管理に関する事項

(1) リスクアベタイト指標

短期指標としての連結流動性カバレッジ比率と長期指標としての長期性資金レシオを流動性に係るリスクアベタイト指標として設定し、管理・モニタリングを行っております。

長期性資金レシオ

長期性資金の十分性を検証するための指標として長期性資金レシオを設定・管理・モニタリングし、1年以上の長期間に亘りストレス環境が継続した場合においても業務を継続するための態勢を確認しております。

(2) コンティンジェンシー・ファンディング・プラン

当社グループは、流動性リスクが顕在化した場合には金融機関の経営破綻に直結するおそれがあることを認識しており、流動性危機時に適切に対応するため、コンティンジェンシー・ファンディング・プランを策定しております。同プランは、信用力の低下等の内生的要因や金融市場の混乱等の外生的要因によるストレスの逼迫度に応じた報告体制や資金調達手段の確保などの方針を定めております。また、早期警戒指標(EWI)を設けて、当社グループの流動性に関する状況をモニタリングしております。これにより当社グループは機動的に流動性を確保する態勢を整備しております。

報酬等に関する事項

1. 当社グループの対象役職員の報酬等に関する組織体制の整備状況に関する事項

(1)「対象役職員」の範囲

対象役員は、当社の取締役及び執行役であります。

対象従業者等については、当社グループでは、対象役員以外の当社の役職員並びに P. 25に記載する主要な連結子会社の役職員のうち、社外取締役を除く対象役職員の報酬の平均を上回る者で、その職責等に照らして当社及びその主要な連結子会社等の業務の運営または財産の状況に重要な影響を与えうる者等を開示の対象としております。具体的には、主要な連結子会社の取締役・監査役及びホールセール部門(グローバル・マーケット)・投資部門等におけるマネージング・ディレクター等を含みます。

(2)対象役職員の報酬等の決定について

役員の報酬については、報酬委員会において、役員報酬に関する方針及び個別報酬内容の決定に関する事項、並びに連結業績向上に資するグループ全体のインセンティブ・プラン等につき検討しております。報酬委員会は委員長を含む3名の社外取締役と社内取締役2名で構成されており、合理的な報酬制度の設計・運用・検証を行うため、委員となる社外取締役の専門性も考慮しています。

職員については、持株会社であるグループ本社人事部門がグループ全体の基本的な報酬体系の枠組みを設計し、その枠組みを踏まえ、各社の人事部門において個社の業務特性等を考慮した運用を行っております。

尚、報酬委員会事務局及びグループ本社人事部門は、必要に応じ、財務部門等との連携を図っております。

(3)リスク管理部門・コンプライアンス部門の役職員の報酬体系の決定について

リスク管理部門・コンプライアンス部門の担当役員は他の収益部門を担当していないため、当該観点からの独立性は高い体制となっております。また、グループ本社の監査委員(社外取締役及び執行役を兼務しない取締役)には業績連動型報酬を支給しておりません。

職員については、リスク管理部門・コンプライアンス部門の職員の報酬体系は他部門の職員と同じとなっておりますが、評価については当該部門における業務実績で評価されております。

(4)報酬委員会の開催回数

	開催回数 (2018年4月～2019年3月)
報酬委員会 (大和証券グループ本社)	5回

(注) 報酬委員会等の職務執行に係る対価に相当する部分のみを切り離して算出することができないため、報酬等の総額は記載しておりません。

2. 当社グループの対象役職員の報酬等の体系の設計及び運用に関する事項

(1)当社役員の報酬等の額の決定に関する方針

取締役及び執行役の報酬については、

- 健全なビジネス展開を通じて株主価値の増大に寄与し、短期及び中長期の業績向上へ結びつくインセンティブが有効に機能すること
- グローバルに展開する証券グループとして、国内はもとより、国際的にも競争力のある水準であること
- 指名委員会等設置会社として、執行と監督が有効に機能すること

を基本方針としております。

取締役及び執行役の報酬は、基本報酬、業績連動型報酬、株価連動型報酬で構成され、具体的には以下のとおりです。

○基本報酬

- 基本報酬は、役職、職責、役割に応じた固定報酬とする。

○業績連動型報酬

- 業績連動型報酬は、中期経営計画において業績KPIとしている連結ROE、連結経常利益を基準に、中期経営計画における経営目標の達成状況等を総合的に加味した上で、個人の貢献度合に応じて決定する。
- 執行役を兼務しない取締役に對しては、業績連動型報酬を設定しない。

○株価連動型報酬

- 株価連動型報酬として、株主価値との連動性を高めるために、基本報酬の一定割合に相当する価値の譲渡制限付株式等を付与する。
- 社外取締役に對しては、株価連動型報酬を設定しない。

(2)当社グループの対象役職員の報酬体系の設計・運用についての重要な変更について

当期より役員の報酬体系において、中長期の業績向上へのインセンティブをより高めるとともに、当社及び当社子会社の取締役・執行役・執行役員等と株主との一層の価値共有を進めることを目的として、譲渡制限付株式報酬制度を導入しております。

3. 当社グループの対象役職員の報酬等の体系とリスク管理の整合性並びに報酬等と業績の連動に関する事項

役員の業績連動型報酬は、原則、連結経常利益に連動しているため、個社・一部の利益ではなくグループ全体の業績向上に向けたインセンティブが働く仕組みとなっております。また、業績連動型報酬を決定する業績評価については利益指標だけではなく定性評価も含まれているため、報酬額が短期的な収益に過度に連動しない仕組みとなっております。

加えて、長期的な企業価値向上へのインセンティブとして、役員報酬の一部を譲渡制限付株式として支給しております。譲渡制限付株式報酬制度は、「株式報酬Ⅰ」と「株式報酬Ⅱ」で構成されます。「株式報酬Ⅰ」は、基本報酬の一定割合に相当する価値の譲渡制限付株式を支給するものであり、当社、当社子会社及び当社関連会社の役員等のいずれの地位も退任した後に譲渡制限を解除することとしております。「株式報酬Ⅱ」は、業績に応じて金銭で支給する業績連動型報酬に一定の上限を設け、これを上回る場合は報酬の一部を金銭から譲渡制限付株式に置き換えて支給するものです。譲渡制限期間は3年としており、業績連動型報酬が一定の上限を上回る場合には実質的な報酬の繰延として機能します。

尚、役職員の業績連動部分はいずれも主に連結経常利益に連動し、業績不振時には相当程度縮小する設計となっているため、報酬等の全体の水準が自己資本に重要な影響を及ぼす体系とはなっていません。また、リスク管理に悪影響を及ぼしかねない、複数年にわたる賞与支払額の最低保証、高額な退職一時金制度が適用されている役職員はおりません。

4. 当社グループの対象役職員の報酬等の種類、支払総額及び支払方法に関する事項

対象役員の報酬等の総額

(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位：人、百万円)

REM1：当該事業年度に割り当てられた報酬等			
項番		イ	ロ
		対象役員	対象従業者等
1	対象役員及び対象従業者等の数	24	4
2	固定報酬の総額 (3+5+7)	1,035	158
3	うち、現金報酬額	1,035	158
4	3のうち、繰延額	0	0
5	うち、株式報酬額又は株式連動型報酬額	0	0
6	5のうち、繰延額	0	0
7	うち、その他報酬額	0	0
8	7のうち、繰延額	0	0
9	対象役員及び対象従業者等の数	17	4
10	変動報酬の総額 (11+13+15)	658	624
11	うち、現金報酬額	471	624
12	11のうち、繰延額	0	39
13	うち、株式報酬額又は株式連動型報酬額	186	0
14	13のうち、繰延額	0	0
15	うち、その他報酬額	0	0
16	15のうち、繰延額	0	0
17	対象役員及び対象従業者等の数	2	0
18	退職慰労金の総額	18	0
19	うち、繰延額	0	0
20	対象役員及び対象従業者等の数	0	0
21	その他の報酬	0	0
22	その他の報酬の総額	0	0
23	うち、繰延額	0	0
23	報酬等の総額 (2+10+18+21)	1,711	782

(注)

1. 退職慰労金には子会社における当期の引当金繰入額を記載しています。
2. 対象役員及び対象従業者等には期中退職者が含まれております。
3. 賞与には、翌期以降に支払いが繰り延べられる繰延報酬 (対象従業者等40百万円) が含まれております。繰延報酬は、報酬額等に応じて複数年の繰延期間を設けており、業績等により将来その一部又は全部について取戻しの可能性があります。

(単位：人、百万円)

REM2：特別報酬等						
	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
	ボーナス保証		採用時一時金		割増退職金	
	人数	総額	人数	総額	人数	総額
対象役員	0	0	0	0	0	0
対象従業者等	0	0	0	0	0	0

5. 当社グループの対象役職員の報酬等の体系に関し、その他参考となるべき事項

特段、前項までに掲げたもののほか、該当する事項はございません。

(単位：人、百万円)

REM3：繰延報酬等						
	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	
	繰延報酬等の残高	イのうち、調整又は変動の対象となる繰延報酬等の残高	割当て後の報酬等に関して、当該事業年度に指標等の変動に連動しない調整を受けた調整額	割当て後の報酬等に関して、当該事業年度に指標等の変動に連動した調整を受けた変動額		当該事業年度に支払われた繰延報酬等の額
対象役員	現金報酬額	0	0	0	0	0
	株式報酬額又は株式連動型報酬額	0	0	0	0	0
	その他の報酬額	0	0	0	0	0
対象従業者等	現金報酬額	79	79	0	0	40
	株式報酬額又は株式連動型報酬額	0	0	0	0	0
	その他の報酬額	0	0	0	0	0
総額		79	79	0	0	40

大和証券 会社概要

94 大和証券概要・沿革

95 組織図

96 役員・政令で定める使用人一覧

97 その他コーポレート情報

115 大和証券 国内サービス網

大和証券概要・沿革

商号

大和証券株式会社

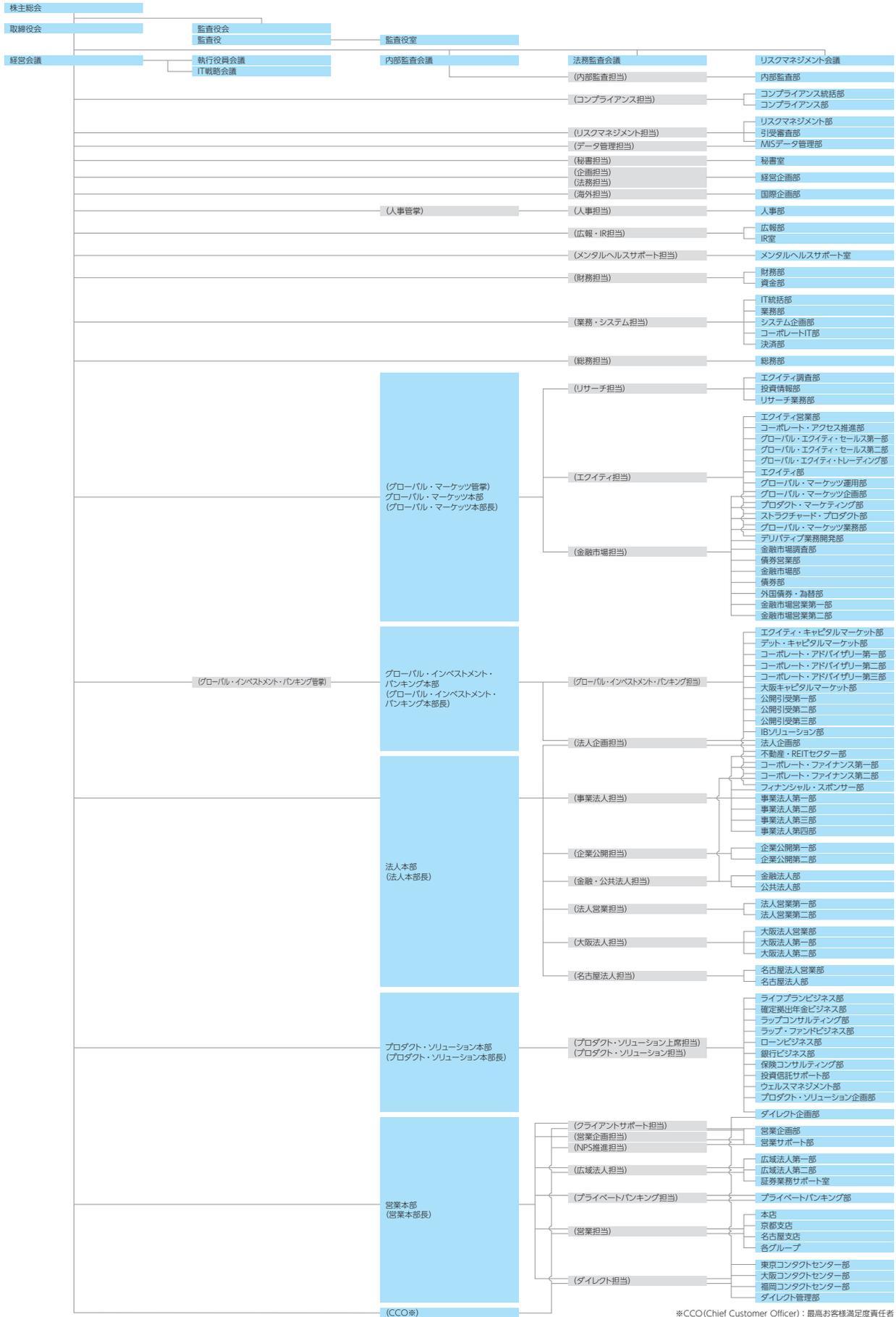
登録年月日(登録番号)

2007年9月30日(関東財務局長(金商)第108号)

会社の沿革(2019年7月1日現在)

年 月	沿 革
1992年 8月	「大和ファイナンス(株)」(現「(株)大和キャピタル・ホールディングス」)の完全子会社として「(株)ボナ」を設立。
1998年12月	「大和証券(株)」(現「(株)大和証券グループ本社」)に全株式を譲渡。
1999年 1月	「大和証券リテール準備(株)」に商号変更。
2月	証券業の登録完了。
4月	「(株)大和証券グループ本社」より営業譲渡を受け、「大和証券(株)」へ商号変更、営業開始。
9月	保険募集業務の開始。
2004年 8月	投資一任業務の開始。
2006年 2月	金融先物取引業務の開始。
2007年 9月	金融商品取引業の登録。
2009年11月	(株)東京金融取引所が提供する取引所外国為替証拠金取引(サービス名称：ダイワ365 F X)の取扱いを開始。
2010年 6月	「大和証券担保ローン(株)」より証券担保ローン事業を譲受。
2011年 4月	銀行代理業務の開始。
2012年 4月	「大和証券キャピタル・マーケット(株)」を吸収合併。
2015年10月	「大和ペンション・コンサルティング(株)」を吸収合併。

組織図 (2019年7月1日現在)



※CCO(Chief Customer Officer)：最高お客様満足度責任者

役員・政令で定める使用人一覧

役員一覧(2019年7月1日)

取締役

代表取締役会長
日比野 隆司
代表取締役社長
中田 誠司
代表取締役副社長
松井 敏浩
代表取締役副社長
高橋 一夫
代表取締役副社長
田代 桂子
専務取締役
丸尾 浩一
専務取締役
赤井 雄一
代表取締役
専務取締役
川上 進次
専務取締役
小松 幹太
専務取締役
中川 雅久
専務取締役
小林 昭広
専務取締役
夏目 景輔

専務取締役
松本 好仙
専務取締役
下村 直人
専務取締役
新妻 信介
専務取締役
荻野 明彦
常務取締役
上村 博美
常務取締役
辻本 将孝
常務取締役
野村 宏之
常務取締役
原 宏
常務取締役
岩崎 靖史
常務取締役
金子 好久
常務取締役
望月 篤
常務取締役
在原 淳一

監査役

監査役
高見 秀三
監査役
赤岩 純行
監査役
花岡 幸子
監査役
大林 宏

執行役員

常務執行役員
大塚 祥史
常務執行役員
藤岡 智男
常務執行役員
白川 香名
常務執行役員
城川 博孝
常務執行役員
藤田 満
常務執行役員
村瀬 智之
常務執行役員
姜 昇浩
常務執行役員
田所 俊弥
常務執行役員
櫻井 裕子
常務執行役員
池田 弘樹

執行役員
伊倉 智毅
執行役員
佐野 径
執行役員
関根 太
執行役員
辻 朋紀
執行役員
佐藤 英二
執行役員
山本 徹
執行役員
芹澤 潤一
執行役員
代田 英展
執行役員
辻岡 功
執行役員
小林 奨

執行役員
高塚 峰生
執行役員
高橋 努務
執行役員
田中 義明
執行役員
成枝 隆明
執行役員
竹内 由紀子
執行役員
若山 朋秀
執行役員
山田 孝志
執行役員
板屋 篤
執行役員
上野 賢一

政令で定める使用人の氏名(2019年7月1日現在)

(1) 金融商品取引業に関し、法令等を遵守させるための指導に関する業務を統括する者の氏名

代表取締役専務取締役 コンプライアンス担当 川上 進次
コンプライアンス統括部長 上野 治久
コンプライアンス部長 田中 義一

(2) 投資助言業務又は投資運用業に関し、助言又は運用を行う部門を統括する者の氏名

専務取締役 プロダクト・ソリューション本部長 下村 直人 専務取締役 リサーチ担当 夏目 景輔 常務取締役 プロダクト・ソリューション上席担当 望月 篤 常務執行役員 プロダクト・ソリューション担当 藤田 満 参与 プロダクト・ソリューション副担当 間宮 賢 参与 リサーチ副担当 藤倉 敬 エクイティ調査部長 成瀬 順也 投資情報部長 高橋 卓也	ラップ・ファンドビジネス部長 間宮 賢 ラップ・ファンドビジネス部 マネーマネージャー 星 宏明 福井 一人 松永 修治 榎本 直之 大平 秀延 近藤 直樹 高橋 健文 相川 章子 似内 正通 米長 忍 網倉 康宏 諏訪 英生 鈴木 央要 内山 涼平 深澤 幸太	ラップコンサルティング部長 廣重 嘉信 ラップコンサルティング部 アセット・アドバイザー 夜久 芳宏 飯島 修子 渡邊 光治 金本 征和 河田 秀憲
--	--	--

(3) 投資助言・代理業に関し、法第29条の2第1項の第6号の営業所又は事務所の業務を統括する者の氏名

専務取締役 プロダクト・ソリューション本部長 下村 直人
常務取締役 プロダクト・ソリューション上席担当 望月 篤
常務執行役員 プロダクト・ソリューション担当 藤田 満
参与 プロダクト・ソリューション副担当 間宮 賢

その他コーポレート情報

業務の種類

- (1) 第一種金融商品取引業(法第28条第1項第1号、第2号、第3号イ、ロ、ハに掲げる行為に係る業務並びに有価証券等管理業務)
- (2) 第二種金融商品取引業
- (3) 投資助言・代理業
- (4) 投資運用業

他に行っている事業の種類

- (1) 商品先物取引法第2条第21項に規定する商品市場における取引に係る業務
- (2) 商品の価格その他の指標に係る変動、市場間の格差等を利用して行う取引に係る業務
- (3) 貸金業法第2条第1項に規定する貸金業その他金銭の貸付け又は金銭の貸借の媒介に係る業務
- (4) 宅地建物取引業法第2条第2号に規定する宅地建物取引業又は同条第1号に規定する宅地若しくは建物の賃貸に係る業務
- (5) 金地金の売買又はその媒介、取次ぎ若しくは代理に係る業務
- (6) 組合契約の締結又はその媒介、取次ぎ若しくは代理に係る業務
- (7) 匿名組合契約の締結又はその媒介、取次ぎ若しくは代理に係る業務
- (8) 貸出参加契約の締結又はその媒介、取次ぎ若しくは代理に係る業務
- (9) 保険業法第2条第26項に規定する保険募集に係る業務
- (10) 確定拠出年金法第2条第7項に規定する確定拠出年金運営管理業
- (11) 国民年金基金連合会から確定拠出年金法第61条第1項の規定による委託を受けて同項第1号、第2号又は第5号に掲げる事務(第5号に掲げる事務にあつては、同法第73条において準用する第22条の措置に関する事務又は同法第2条第3項に規定する個人型年金に係る届出の受理に関する事務に限る。)を行う業務
- (12) 信託業法第2条第8項に規定する信託契約代理業
- (13) 金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項第4号に掲げる業務若しくは同項第6号に掲げる業務のうち遺言の執行に関するもの又は同号若しくは同項第7号(イを除く。)に掲げる業務のうち、遺産の整理に関するものに係る契約の締結の媒介(信託業務を営む金融機関のために行うものに限る。)に係る業務
- (14) 銀行法第2条第14項に規定する銀行代理業
- (15) 算定割当量の取得若しくは譲渡に関する契約の締結又はその媒介、取次ぎ若しくは代理を行う業務
- (16) その行う業務に係る顧客に対し他の事業者のあっせん又は紹介を行う業務
- (17) 郵便貯金及び預金等の受払事務の受託に関する業務
- (18) 前各号に掲げる業務に附帯する業務

手続実施基本契約を締結する指定紛争機関の商号又は名称並びに加入する金融商品取引業協会及び対象事業者となる認定投資者保護団体の名称

(手続実施基本契約を締結する指定紛争解決機関の商号又は名称)
 特定非営利活動法人 証券・金融商品あっせん相談センター(特定第一種金融商品取引業に限る)
 (加入する金融商品取引業協会)
 日本証券業協会
 一般社団法人 日本投資顧問業協会
 一般社団法人 金融先物取引業協会
 一般社団法人 第二種金融商品取引業協会
 (対象事業者となる認定投資者保護団体の名称)
 なし

会員等となる金融商品取引所の名称又は商号

東京証券取引所
 大阪取引所
 名古屋証券取引所
 福岡証券取引所
 札幌証券取引所
 東京金融取引所

加入する投資者保護基金の名称

日本投資者保護基金

金融商品取引業等に関する内閣府令第7条第3号イ及び第4号から第9号までに掲げる事項のうち、当社が行う業務

有価証券関連業
 不動産信託受益権等売買等業務

役員・使用人の総数及び外務員の総数

	2017年 3月期末	2018年 3月期末	2019年 3月期末
役員	22名	23名	23名
使用人	8,825名	9,074名	9,195名
合計	8,847名	9,097名	9,218名
内、日本証券業協会に登録している外務員	8,558名	8,802名	8,951名
内、金融先物取引業協会に登録している外務員	1,105名	1,131名	1,130名

株式の保有数の上位10位までの株主の氏名又は名称並びにその株式の保有数及び総株主等の議決権に占める当該株式に係る議決権の数の割合

(2019年6月30日現在)

氏名又は名称	保有株式数	割合
株式会社大和証券グループ本社	810,200株	100%
合計	810,200株	100%

大和証券における業務の状況に関する事項

1. 経営成績に関する分析

業績の概況

当事業年度(2018年4月1日から2019年3月31日までの12ヶ月間)の純営業収益は、2,928億28百万円(対前事業年度増減率10.2%減)となりました。販売費・一般管理費は2,394億92百万円(同0.4%減)となりました。経常利益は537億10百万円(同38.0%減)、法人税など控除後の当期純利益は382億97百万円(同40.6%減)となりました。

(1) 受入手数料

受入手数料合計は1,857億41百万円(同11.2%減)となりました。

① 委託手数料

委託手数料は430億43百万円(同23.4%減)となりました。

② 引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料

引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料は365億63百万円(同29.4%増)となりました。

③ 募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料

募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料は258億40百万円(同43.0%減)となりました。

④ その他の受入手数料

その他の受入手数料は802億95百万円(同1.2%増)となりました。

(2) トレーディング損益

トレーディング損益合計は891億68百万円(同10.8%減)となりました。内訳は、株券等トレーディング損益398億47百万円(同1.4%減)、債券等トレーディング損益425億19百万円(同5.3%減)、その他トレーディング損益68億2百万円(同53.5%減)となっております。

(3) 金融収支

金融収益は574億64百万円(同15.6%増)、金融費用は395億45百万円(同20.7%増)となり、金融収支は179億19百万円(同5.7%減)となりました。

(4) 販売費・一般管理費

人件費は980億21百万円(同4.6%減)、事務費は469億34百万円(同0.9%増)、取引関係費は429億3百万円(同4.6%増)、不動産関係費は250億88百万円(同1.0%増)、減価償却費は174億83百万円(同6.8%増)となり、販売費・一般管理費合計は2,394億92百万円(同0.4%減)となりました。

2. 財政状態に関する分析

資産合計は9兆8,328億25百万円(対前事業年度末比1兆8,500億円減)、負債合計は9兆605億44百万円(同1兆8,213億円減)、純資産合計は7,722億81百万円(同287億円減)となりました。

内部管理の状況の概要 (2019年6月30日現在)

(1) コンプライアンス体制

当社は、金融商品取引市場の仲介者としての社会的責任を認識し、法令諸規則を遵守した業務活動を実践するために、内部管理態勢の一層の強化・充実に努めています。

内部管理態勢の整備、強化についてはコンプライアンス統括部及びコンプライアンス部(以下、コンプライアンス部門という)が所管し、「お客様第一」に基づく適切な勧誘が行われるようモニタリングと指導・教育を行うなど、法令諸規則違反等の未然防止に努めています。

また、全営業部店に内部管理責任者を配置し、コンプライアンス部門と連携を取りながら営業品質の改善・向上を図る態勢を取っています。

各組織等の概要は次のとおりです。

① 法務監査会議

当社は、金融商品取引法をはじめとする法令諸規則の遵守、企業倫理の確立、及び内部管理等に係る事項に関する重要事項の報告、全般的方針及び具体的施策等の審議・決定の場として、法務監査会議を設置しています。

法務監査会議は取締役会の下部機関として設置され、社長を議長として取締役及び執行役員で構成されています。また、監査役及び弁護士も出席し、審議・報告内容について、公正かつ中立な立場からチェックを行っています。

② コンプライアンス部門

コンプライアンス部門では、当社及び役職員による法令等の遵守に関する具体的な実践計画として、毎年度コンプライアンス・プログラムを策定し、内部管理態勢の継続的な強化に努めています。

コンプライアンスの実践を図るためのツールとして、コンプライアンス・マニュアルを整備し、社内イントラネット上で全役職員が閲覧できる状態にしています。また、社内放送、各種研修、テスト等を通じ、役職員に対するコンプライアンス意識の醸成を図っています。

一方、現場で自浄作用が働く態勢の構築を目的として、全部室店で毎月自主点検を行い、業務の適正性を検証しています。さらに、各営業店では毎月コンプライアンス会議を開催し、支店長が議長となって自店の問題点の具体的解決に向けた討議や法令諸規則遵守に係る各種指導を行っています。本部部署においても、ライン部長と内部管理責任者が連携し、業務特性に応じたコンプライアンスに関する各種研修や注意喚起を恒常的に行うなど、内部管理態勢の強化に取り組むとともに、市場のゲートキーパーとしての適正な機能発揮に努めています。

コンプライアンス部門では、こうした活動を通じて全役職員が法令諸規則・ルールの趣旨や背景といった「本質」を理解するよう、意識の醸成を図るとともに、「3つの防衛線」に基づくリスク管理の考え方の浸透を図っています。そして、違反行為の未然防止と早期発見、お客様からの苦情に関する調査・対応、お客様の個人情報・当社情報資産に関する管理と取扱いに関する指導・教育、不公正取引や反社会的勢力の排除、マナー・ローダリング及びテロ資金供与対策等に取り組んでいます。

(2) お客様からのご意見及び苦情への対応について

当社は、お客様からいただいたご意見・苦情については、以下の手順にて対応しています。

お客様からのご意見・苦情は、営業店もしくは本社・お客様相談センターにて十分に伺い、お申出内容を正確に把握します。事実関係を調査したうえで、お客様に丁寧に説明します。

調査の結果、当社に法令上の問題等が認められた場合には、法令等違反行為として取り扱い、然るべく対応します。一方、当社に法令上の問題が認められない場合、または当社の責任が立証できない場合には、その旨をお客様に説明します。

お客様と当社の間に見解の相違がある場合などは、苦情・紛争解決のための窓口として、「特定非営利活動法人 証券・金融商品あっせん相談センター (FINMAC)」等を紹介いたします。

また、お客様からいただいたご意見及び苦情は、営業店・本部部署と情報を共有し、再発防止・お客様サービスの向上に努めます。

(3) 情報セキュリティについて

当社は、金融・資本市場の担い手としての社会的責任を果たし、お客様からの強固な信頼を獲得すべく、お客様からお預りした個人情報をはじめとする情報資産を安全かつ正確に保護するためのさまざまな情報セキュリティ対策に取り組んでいます。

例えば、情報セキュリティに関する基本方針を定め、この基本方針に則り、関連諸規程等のルールを整備しています。

そして、それらのルールを役職員に遵守させるため、社内イントラネット等を通じて周知すると共に、eラーニング等を通じた情報セキュリティに関する教育・研修や確認テスト等を定期的実施し、周知徹底を図っています。なお、サイバーセキュリティに関する教育・研修の一環として、「標的型攻撃メール」の訓練も実施しています。

また、個人情報保護を徹底するため、各部室店において、施錠管理、個人情報の持出等の台帳管理、メール査閲等を日々実施しています。

(4) 内部監査体制

内部監査部が、当社の内部統制態勢の適切性・有効性の検証及び監査結果に基づく改善提言を行っております。特に、当社においてはお客様第一の業務運営やグローバルな金融商品取引業者としての法令遵守態勢、リスク管理態勢に留意して内部管理態勢の適切性・有効性を検証することを通じて企業価値の向上を図っています。

業務の状況を示す指標

(1) 経営成績等の推移

(単位：百万円)

	2017年3月期	2018年3月期	2019年3月期
資本金	100,000	100,000	100,000
発行済株式総数	810,200株	810,200株	810,200株
営業収益	334,911	358,835	332,374
(受入手数料)	181,235	209,183	185,741
((委託手数料))	44,652	56,205	43,043
((引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料))	27,535	28,259	36,563
((募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料))	33,477	45,357	25,840
((その他の受入手数料))	75,569	79,361	80,295
(トレーディング損益)	116,237	99,962	89,168
((株券等))	21,715	40,414	39,847
((債券等))	73,304	44,911	42,519
((その他))	21,253	14,636	6,802
純営業収益	314,102	326,092	292,828
経常利益	85,234	86,664	53,710
当期純利益	58,461	64,436	38,297

(2) 有価証券引受・売買等の状況

① 株券の売買高の推移

		2017年3月期	2018年3月期	2019年3月期
自己	株数	43,726百万株	30,995百万株	21,289百万株
	金額	52,176,987百万円	52,564,343百万円	41,343,058百万円
委託	株数	32,343百万株	27,769百万株	21,177百万株
	金額	37,817,478百万円	44,825,460百万円	41,268,562百万円
計	株数	76,070百万株	58,765百万株	42,467百万株
	金額	89,994,465百万円	97,389,804百万円	82,611,620百万円

② 有価証券の引受け及び売出し並びに特定投資家向け売付け勧誘等並びに有価証券の募集・売出し及び私募の取扱い並びに特定投資家向け売付け勧誘等の取扱いの状況

(単位：千株、百万円)

区分		引受高	売出高	特定投資家向け売付け勧誘等の総額	募集の取扱高	売出しの取扱高	私募の取扱高	特定投資家向け売付け勧誘等の取扱高
2019年3月期	株券	千株	千株	千株	千株	千株	千株	千株
		437,709	437,707	-	0	0	0	-
		百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円
		741,207	739,207	-	0	0	1,980	-
	国債証券	-	-	-	825,085	-	-	-
	地方債証券	918,445	-	-	917,842	-	-	-
	特殊債券	1,308,223	-	-	1,283,490	-	0	-
	社債券	2,720,375	120,557	-	2,447,625	27,097	644,548	-
	受益証券	-	-	-	4,200,448	-	-	-
	その他	51,000	-	-	-	-	-	-
合計	5,739,250	859,764	-	9,674,490	27,097	646,528	-	
2018年3月期	株券	千株	千株	千株	千株	千株	千株	千株
		423,751	423,751	-	-	-	0	-
		百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円
		648,887	648,887	-	-	-	39,200	-
	国債証券	-	-	-	648,664	-	-	-
	地方債証券	957,021	-	-	956,660	-	-	-
	特殊債券	1,527,996	-	-	1,501,130	-	2,000	-
	社債券	2,260,600	135,360	-	1,854,600	52,741	443,700	-
	受益証券	-	-	-	5,542,155	-	564,379	-
	その他	35,200	-	-	-	-	-	-
合計	5,429,704	784,247	-	10,503,209	52,741	1,049,279	-	
2017年3月期	株券	千株	千株	千株	千株	千株	千株	千株
		254,631	254,631	-	-	-	10	-
		百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円
		472,286	472,019	-	-	-	16,532	-
	国債証券	-	-	-	134,879	-	-	-
	地方債証券	880,694	-	-	880,269	-	-	-
	特殊債券	1,310,836	-	-	1,297,170	-	-	-
	社債券	2,046,571	319,998	-	1,325,500	161,402	702,760	-
	受益証券	-	-	-	6,967,980	-	354,608	-
	その他	100	-	-	-	-	100	-
合計	4,710,488	792,017	-	10,605,800	161,402	1,074,000	-	

(3) その他業務の状況

① 保険募集業務に係る手数料

(単位：百万円)

	2017年3月期	2018年3月期	2019年3月期
保険募集業務に係る手数料	4,363	3,073	2,820

② 証券担保ローンの取扱残高(貸付残高)

(単位：百万円)

	2017年3月期	2018年3月期	2019年3月期
証券担保ローンの取扱残高	86,760	95,895	116,995

(4) 自己資本規制比率の状況

(単位：%、百万円)

	2017年3月期	2018年3月期	2019年3月期	
基本的項目(A)	832,198	796,169	770,031	
補完的項目	その他有価証券評価差額金(評価益)等	6,995	4,852	2,249
	金融商品取引責任準備金等	3,915	3,931	3,924
	一般貸倒引当金	140	146	110
	長期劣後債務	53,770	52,465	51,180
	短期劣後債務	3,355	4,060	5,245
計(B)	68,176	65,454	62,710	
控除資産(C)	102,821	107,307	124,353	
固定化されていない自己資本((A)+(B)-(C)(D))	797,553	754,316	708,388	
リスク相当額	市場リスク相当額	86,678	93,150	88,684
	取引先リスク相当額	53,526	62,382	51,290
	基礎的リスク相当額	56,594	60,976	64,385
	計(E)	196,800	216,510	204,359
自己資本規制比率(D)/(E)×100	405.2	348.3	346.6	

財務諸表

貸借対照表

(単位：百万円)

科目	2018年3月期 (2018年3月31日現在)	2019年3月期 (2019年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産	11,567,752	9,709,904
現金・預金	1,314,548	1,436,026
預託金	327,069	304,071
有価証券	3,000	1,000
トレーディング商品	5,163,208	4,585,633
商品有価証券等	2,668,054	1,658,180
デリバティブ取引	2,495,153	2,927,453
約定見返勘定	—	196,596
信用取引資産	256,387	171,124
信用取引貸付金	224,933	153,579
信用取引借証券担保金	31,453	17,544
有価証券担保貸付金	3,811,926	2,157,871
借入有価証券担保金	3,686,573	1,260,457
現先取引貸付金	125,353	897,413
立替金	17,341	28,281
短期差入保証金	307,890	386,976
短期貸付金	320,901	409,872
未収収益	24,047	26,533
その他	21,581	6,031
貸倒引当金	△149	△114
固定資産	115,148	122,920
有形固定資産	3,082	7,288
器具備品	2,285	3,181
その他	797	4,107
無形固定資産	65,670	74,794
ソフトウェア	41,129	52,774
その他	24,541	22,020
投資その他の資産	46,394	40,837
投資有価証券	14,444	9,456
関係会社株式	1,135	1,135
長期貸付金	4,874	4,874
長期差入保証金	15,298	15,416
繰延税金資産	8,848	7,917
その他	4,708	4,939
貸倒引当金	△2,914	△2,902
資産合計	11,682,900	9,832,825

科目	2018年3月期 (2018年3月31日現在)	2019年3月期 (2019年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債	9,421,792	7,560,799
トレーディング商品	3,850,445	3,593,928
商品有価証券等	1,651,658	894,801
デリバティブ取引	2,198,787	2,699,126
約定見返勘定	329,873	—
信用取引負債	70,598	68,612
信用取引借入金	2,347	2,536
信用取引貸証券受入金	68,251	66,076
有価証券担保借入金	2,920,274	1,757,345
有価証券貸借取引受入金	1,724,185	305,127
現先取引借入金	1,196,088	1,452,218
預り金	220,041	223,495
受入保証金	413,997	367,144
短期借入金	1,242,432	1,263,723
コマーシャル・ペーパー	105,000	100,000
1年内償還予定の社債	185,558	129,123
未払金	30,302	18,597
未払費用	16,110	15,534
未払法人税等	5,025	2,316
賞与引当金	16,584	10,970
その他	15,546	10,005
固定負債	1,456,154	1,495,820
社債	583,323	626,243
長期借入金	838,156	830,453
退職給付引当金	30,477	31,676
訴訟損失引当金	1,968	1,799
その他	2,228	5,647
特別法上の準備金	3,931	3,924
金融商品取引責任準備金	3,931	3,924
負債合計	10,881,878	9,060,544
(純資産の部)		
株主資本	796,169	770,031
資本金	100,000	100,000
資本剰余金	349,920	349,920
資本準備金	50,010	50,010
その他資本剰余金	299,910	299,910
利益剰余金	346,249	320,111
利益準備金	2,430	2,430
その他利益剰余金	343,819	317,681
繰越利益剰余金	343,819	317,681
評価・換算差額等	4,852	2,249
その他有価証券評価差額金	4,852	2,249
純資産合計	801,022	772,281
負債及び純資産合計	11,682,900	9,832,825

損益計算書

(単位：百万円)

科目	2018年3月期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	2019年3月期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益	358,835	332,374
受入手数料	209,183	185,741
トレーディング損益	99,962	89,168
金融収益	49,689	57,464
金融費用	32,742	39,545
純営業収益	326,092	292,828
販売費・一般管理費	240,538	239,492
営業利益	85,554	53,336
営業外収益	1,945	804
営業外費用	835	430
経常利益	86,664	53,710

(右上に続く)

(単位：百万円)

科目	2018年3月期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	2019年3月期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
特別利益	4,868	3,491
投資有価証券売却益	3,699	3,484
償却債権取立益	481	—
移転補償金	688	—
金融商品取引責任準備金戻入	—	6
特別損失	2,395	635
固定資産除売却損	172	56
金融商品取引責任準備金繰入れ	16	—
移転関連費用	2,034	575
その他	171	3
税引前当期純利益	89,138	56,566
法人税、住民税及び事業税	25,289	16,217
法人税等調整額	△587	2,051
当期純利益	64,436	38,297

株主資本等変動計算書

2019年3月期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位：百万円)

項目	株主資本							評価・換算差額等		純資産合計	
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			株主資本合計	其他有価証券評価差額金		評価・換算差額等合計
		資本準備金	其他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	其他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計				
2018年4月1日残高	100,000	50,010	299,910	349,920	2,430	343,819	346,249	796,169	4,852	4,852	801,022
事業年度中の変動額											
剰余金の配当	—	—	—	—	—	△64,436	△64,436	△64,436	—	—	△64,436
当期純利益	—	—	—	—	—	38,297	38,297	38,297	—	—	38,297
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額(純額)	—	—	—	—	—	—	—	—	△2,602	△2,602	△2,602
事業年度中の変動額合計	—	—	—	—	—	△26,138	△26,138	△26,138	△2,602	△2,602	△28,741
2019年3月31日残高	100,000	50,010	299,910	349,920	2,430	317,681	320,111	770,031	2,249	2,249	772,281

2018年3月期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位：百万円)

項目	株主資本							評価・換算差額等		純資産合計	
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			株主資本合計	其他有価証券評価差額金		評価・換算差額等合計
		資本準備金	其他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	其他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計				
2017年4月1日残高	100,000	50,010	299,910	349,920	2,430	379,848	382,278	832,198	6,995	6,995	839,193
事業年度中の変動額											
剰余金の配当	—	—	—	—	—	△100,464	△100,464	△100,464	—	—	△100,464
当期純利益	—	—	—	—	—	64,436	64,436	64,436	—	—	64,436
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額(純額)	—	—	—	—	—	—	—	—	△2,143	△2,143	△2,143
事業年度中の変動額合計	—	—	—	—	—	△36,028	△36,028	△36,028	△2,143	△2,143	△38,171
2018年3月31日残高	100,000	50,010	299,910	349,920	2,430	343,819	346,249	796,169	4,852	4,852	801,022

財務諸表の作成について

当社の計算書類は、「会社計算規則」(平成18年法務省令第13号)並びに同規則第118条の規定に基づき、当社の貸借対照表及び損益計算書に適用される「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)及び「有価証券関連業經理の統一に関する規則」(昭和49年11月14日付日本証券業協会自主規制規則)に準拠して作成しております。

記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

当社の計算書類は、「会社計算規則」(平成18年法務省令第13号)並びに同規則第118条の規定に基づき、当社の貸借対照表及び損益計算書に適用される「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)及び「有価証券関連業經理の統一に関する規則」(昭和49年11月14日付日本証券業協会自主規制規則)に準拠して作成しております。

記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

重要な会計方針に係る事項に関する注記

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1) トレーディング商品に属する有価証券等の評価基準及び評価方法

トレーディング商品に属する有価証券及びデリバティブ取引等については、時価法で計上しております。

(2) トレーディング商品に属さない有価証券等の評価基準及び評価方法

ア 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法によっております。

イ 満期保有目的の債券

償却原価法によっております。

ウ その他有価証券

時価のあるものについては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、売却原価は移動平均法により算定)、時価を把握することが極めて困難と認められるもの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。

なお、投資事業有限責任組合等への出資については、当該組合等の財務諸表に基づいて、組合等の純資産を出資持分割合に応じて、投資有価証券として計上しております(組合等の保有する有価証券の評価差額については、その持分相当額を全部純資産直入法により処理しております)。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。なお、耐用年数については、法人税法に規定する方法と同一の基準によっております。

(2) 無形固定資産、投資その他の資産

定額法によっております。なお、耐用年数については、主として法人税法に規定する方法と同一の基準によっております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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により計上しております。

(2) 賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支払いに備えるため、当社所定の計算基準による支払見積額の当期負担分を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、社内規程に基づく当期末における要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて、事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためであります。

(4) 訴訟損失引当金

証券取引に関する損害賠償請求訴訟等について、今後の損害賠償金の支払いに備えるため、経過状況等に基づく当期末における支払見積額を計上しております。

4. その他計算書類作成のための基本となる重要な事項

(1) 繰延資産の処理方法

社債発行費は、全額支出時の費用として処理しております。

(2) 消費税等の会計処理方法

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

(3) 連結納税制度の適用

株式会社大和証券グループ本社を連結納税親会社とする連結納税制度を適用しております。

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1) トレーディング商品に属する有価証券等の評価基準及び評価方法

トレーディング商品に属する有価証券及びデリバティブ取引等については、時価法で計上しております。

(2) トレーディング商品に属さない有価証券等の評価基準及び評価方法

ア 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法によっております。

イ 満期保有目的の債券

償却原価法によっております。

ウ その他有価証券

時価のあるものについては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、売却原価は移動平均法により算定)、時価を把握することが極めて困難と認められるもの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。

なお、投資事業有限責任組合等への出資については、当該組合等の財務諸表に基づいて、組合等の純資産を出資持分割合に応じて、投資有価証券として計上しております(組合等の保有する有価証券の評価差額については、その持分相当額を全部純資産直入法により処理しております)。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。なお、耐用年数については、法人税法に規定する方法と同一の基準によっております。

(2) 無形固定資産、投資その他の資産

定額法によっております。なお、耐用年数については、主として法人税法に規定する方法と同一の基準によっております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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により計上しております。

(2) 賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支払いに備えるため、当社所定の計算基準による支払見積額の当期負担分を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、社内規程に基づく当期末における要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて、事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためであります。

(4) 訴訟損失引当金

証券取引に関する損害賠償請求訴訟等について、今後の損害賠償金の支払いに備えるため、経過状況等に基づく当期末における支払見積額を計上しております。

4. その他計算書類作成のための基本となる重要な事項

(1) 繰延資産の処理方法

社債発行費は、全額支出時の費用として処理しております。

(2) 消費税等の会計処理方法

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

(3) 連結納税制度の適用

株式会社大和証券グループ本社を連結納税親会社とする連結納税制度を適用しております。

表示方法の変更

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

貸借対照表等に関する注記

1. 担保に供している資産及び担保に係る債務

(1) 担保に供している資産

トレーディング商品	638,005百万円
(注) 上記の金額は貸借対照表計上額によっております。なお、上記担保資産の他に、借り入れた有価証券36,769百万円を担保として差し入れております。	

(2) 担保に係る債務

短期借入金	10,000百万円
(注) 上記の金額は貸借対照表計上額によっております。	

2. 差入有価証券及び受入有価証券

(1) 差入有価証券

(内訳) 消費貸借契約により貸し付けた有価証券	3,424,856百万円
現先取引で売り付けた有価証券	1,726,034百万円
その他	1,200,335百万円
その他	498,486百万円
(注) 上記1. (1) 担保に供している資産に属するものは除いております。	

(2) 受入有価証券

(内訳) 消費貸借契約により借り入れた有価証券	4,341,870百万円
現先取引で買い付けた有価証券	3,862,244百万円
その他	121,530百万円
その他	358,095百万円

3. 有形固定資産の減価償却累計額

16,045百万円

4. 保証債務

被保証者	被保証債務の内容	金額(百万円)
親会社の子会社	デリバティブ取引等	338
従業員	借入金	68
計		406

5. 関係会社に対する金銭債権債務

短期金銭債権	64,374百万円
長期金銭債権	1,448百万円
短期金銭債務	368,409百万円
長期金銭債務	421,616百万円

6. 特別法上の準備金の計上を規定した法令の条項

金融商品取引責任準備金 金融商品取引法第46条の5第1項

1. 担保に供している資産及び担保に係る債務

(1) 担保に供している資産

トレーディング商品	553,284百万円
(注) 上記の金額は貸借対照表計上額によっております。なお、上記担保資産の他に、借り入れた有価証券17,361百万円を担保として差し入れております。	

(2) 担保に係る債務

短期借入金	250,000百万円
(注) 上記の金額は貸借対照表計上額によっております。	

2. 差入有価証券及び受入有価証券

(1) 差入有価証券

(内訳) 消費貸借契約により貸し付けた有価証券	2,188,172百万円
現先取引で売り付けた有価証券	304,475百万円
その他	1,464,754百万円
その他	418,942百万円
(注) 上記1. (1) 担保に供している資産に属するものは除いております。	

(2) 受入有価証券

(内訳) 消費貸借契約により借り入れた有価証券	2,463,139百万円
現先取引で買い付けた有価証券	1,317,322百万円
その他	897,742百万円
その他	248,074百万円

3. 有形固定資産の減価償却累計額

15,919百万円

4. 保証債務

被保証者	被保証債務の内容	金額(百万円)
親会社の子会社	デリバティブ取引等	1,969
従業員	借入金	47
計		2,017

5. 関係会社に対する金銭債権債務

短期金銭債権	50,625百万円
長期金銭債権	1,396百万円
短期金銭債務	356,029百万円
長期金銭債務	415,653百万円

6. 特別法上の準備金の計上を規定した法令の条項

金融商品取引責任準備金 金融商品取引法第46条の5第1項

損益計算書に関する注記

関係会社との取引高

(1) 営業取引

受入手数料	683百万円
トレーディング損益	1,026百万円
金融収益	6百万円
金融費用	8,223百万円
販売費・一般管理費	132百万円

(2) 営業取引以外の取引

74百万円

関係会社との取引高

(1) 営業取引

受入手数料	590百万円
トレーディング損益	△3,153百万円
金融収益	△17百万円
金融費用	10,944百万円
販売費・一般管理費	134百万円

(2) 営業取引以外の取引

83百万円

株主資本等変動計算書に関する注記

1. 当期末における発行済株式の数

810,200株

2. 当期末における自己株式の数

該当事項はありません。

3. 当期中に行った剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配当額 (円)
2017年6月22日 定時株主総会	普通株式	100,464	124,000
計		100,464	

4. 当期の末日後に行う剰余金の配当(基準日が当期中のもの)に関する事項

株主総会において、次のとおり決議頂く予定です。

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額 64,436百万円

(2) 配当財産が金銭以外の財産である場合における当該財産の帳簿価額
該当事項はありません。

5. 当期末における当社が発行している新株予約権の目的となる当社の株式の数

該当事項はありません。

1. 当期末における発行済株式の数

810,200株

2. 当期末における自己株式の数

該当事項はありません。

3. 当期中に行った剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配当額 (円)
2018年6月20日 定時株主総会	普通株式	64,436	79,531
計		64,436	

4. 当期の末日後に行う剰余金の配当(基準日が当期中のもの)に関する事項

株主総会において、次のとおり決議頂く予定です。

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額 38,297百万円

(2) 配当財産が金銭以外の財産である場合における当該財産の帳簿価額
該当事項はありません。

5. 当期末における当社が発行している新株予約権の目的となる当社の株式の数

該当事項はありません。

税効果会計に関する注記

繰延税金資産及び繰延税金負債の発生主な原因別の内訳

繰延税金資産	
退職給付引当金	9,347百万円
賞与引当金	4,928
商品有価証券・デリバティブ	2,405
金融商品取引責任準備金	1,203
事業税・事業所税	1,083
投資有価証券評価損	561
減価償却超過額	326
その他	6,151
繰延税金資産 小計	26,009
評価性引当額	△14,523
繰延税金資産 合計	11,485
繰延税金負債	
その他有価証券評価差額金	2,053
その他	583
繰延税金負債 合計	2,636
繰延税金資産の純額	8,848

繰延税金資産及び繰延税金負債の発生主な原因別の内訳

繰延税金資産	
退職給付引当金	9,719百万円
賞与引当金	3,250
商品有価証券・デリバティブ	2,104
資産除去債務	1,730
金融商品取引責任準備金	1,201
事業税・事業所税	660
投資有価証券評価損	593
減価償却超過額	348
その他	5,554
繰延税金資産 小計	25,163
評価性引当額	△15,047
繰延税金資産 合計	10,115
繰延税金負債	
資産除去債務に対応する除去費用	1,257
その他有価証券評価差額金	933
その他	7
繰延税金負債 合計	2,197
繰延税金資産の純額	7,917

金融商品に関する注記

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は有価証券関連業を中核とする投資・金融サービス業を行っております。具体的には、有価証券及びデリバティブ商品の売買等及び売買等の委託の媒介、有価証券の引受け及び売出し、有価証券の募集及び売出しの取扱い、有価証券の私募の取扱い、その他有価証券関連業並びに金融業等を営んでおります。

これらの業務において、当社では商品有価証券等、デリバティブ取引、投資有価証券等の金融資産・負債を保有する他、社債、メディアム・ターム・ノート、金融機関借入等による資金調達を行っております。資金調達を行う際には、ビジネスを継続する上で十分な流動性を効率的に確保するという資金調達の基本方針の下、調達手段及び償還期限の多様化を図りながら、資産と負債の適正なバランスの維持に努め、効率的かつ安定的な資金調達の実現を図っております。また、主に金利スワップ及び通貨スワップ等を金融資産・負債に関する金利変動及び為替変動の影響をヘッジする目的で利用しております。

当社では保有する金融資産・負債から生ずる様々なリスクをその特性に応じて適切に管理し、財務の健全性の維持を図っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

当社はトレーディング業務において、①有価証券等(株券・ワラント、債券及び受益証券等)、有価証券担保貸付金・借入金、信用取引資産・負債等、②株価指数先物・債券先物・金利先物及びこれらのオプション取引に代表される取引所取引のデリバティブ商品、③金利スワップ及び通貨スワップ・先物外国為替取引・選択権付債券売買・通貨オプション・FRA・有価証券店頭デリバティブ等の取引所取引以外のデリバティブ商品(店頭デリバティブ取引)等の金融商品を保有しております。また、取引関係上の目的等で投資有価証券等の金融商品を保有しております。

これらの金融商品に内在する様々なリスクのうち、主要なものは市場リスクと信用リスクです。市場リスクとは、株式・金利・為替・コモディティ等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指します。また、信用リスクとは、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、あるいは信用力の変化等によって損失を被るリスクを指します。

なお、トレーディング業務において、顧客のニーズに対応するために行っている単独又は仕組債等に組込まれたデリバティブ取引の中には、対象資産である株式・金利・為替・コモディティ等の変動並びにそれらの相関に対する変動率が大きいものや、複雑な変動をするものが含まれており、対象資産に比べたリスクが高くなっております。これらのデリバティブ取引は、貸借対照表のトレーディング商品等を含めており、また、時価変動による実現・未実現の損益は、トレーディング損益として計上しております。

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は有価証券関連業を中核とする投資・金融サービス業を行っております。具体的には、有価証券及びデリバティブ商品の売買等及び売買等の委託の媒介、有価証券の引受け及び売出し、有価証券の募集及び売出しの取扱い、有価証券の私募の取扱い、その他有価証券関連業並びに金融業等を営んでおります。

これらの業務において、当社では商品有価証券等、デリバティブ取引、投資有価証券等の金融資産・負債を保有する他、社債、メディアム・ターム・ノート、金融機関借入、コマーシャル・ペーパー、コールマネー、現先取引、レボ取引等による資金調達を行っております。資金調達を行う際には、ビジネスを継続する上で十分な流動性を効率的に確保するという資金調達の基本方針の下、調達手段及び償還期限の多様化を図りながら、資産と負債の適正なバランスの維持に努め、効率的かつ安定的な資金調達の実現を図っております。また、主に金利スワップ及び通貨スワップ等を金融資産・負債に関する金利変動及び為替変動の影響をヘッジする目的で利用しております。

当社では保有する金融資産・負債から生ずる様々なリスクをその特性に応じて適切に管理し、財務の健全性の維持を図っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

当社はトレーディング業務において、①有価証券等(株券・ワラント、債券及び受益証券等)、有価証券担保貸付金・借入金、信用取引資産・負債等、②株価指数先物・債券先物・金利先物及びこれらのオプション取引に代表される取引所取引のデリバティブ商品、③金利スワップ及び通貨スワップ・先物外国為替取引・選択権付債券売買・通貨オプション・FRA・有価証券店頭デリバティブ等の取引所取引以外のデリバティブ商品(店頭デリバティブ取引)等の金融商品を保有しております。また、取引関係上の目的等で投資有価証券等の金融商品を保有しております。

これらの金融商品に内在する様々なリスクのうち、主要なものは市場リスクと信用リスクです。市場リスクとは、株式・金利・為替・コモディティ等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指します。また、信用リスクとは、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、あるいは信用力の変化等によって損失を被るリスクを指します。

なお、トレーディング業務において、顧客のニーズに対応するために行っている単独又は仕組債等に組込まれたデリバティブ取引の中には、対象資産である株式・金利・為替・コモディティ等の変動並びにそれらの相関に対する変動率が大きいものや、複雑な変動をするものが含まれており、対象資産に比べたリスクが高くなっております。これらのデリバティブ取引は、貸借対照表のトレーディング商品等を含めており、また、時価変動による実現・未実現の損益は、トレーディング損益として計上しております。

また、当社は金融商品を保有するとともに、社債、メディアム・ターム・ノート、金融機関借入等による資金調達を行っており、流動性リスクに晒されております。流動性リスクとは、市場環境の変化や当社の財務内容の悪化等により資金繰りに支障をきたす、あるいは通常よりも著しく高い調達コストを余儀なくされることにより損失を被るリスクを指します。

当社では、デリバティブ市場における仲介業者及び最終利用者としてデリバティブ取引を利用しております。デリバティブ商品は顧客の様々な金融ニーズに対応するための必要不可欠な商品となっており、仲介業者として顧客の要望に応じるために様々な形で金融商品を提供しております。例えば、顧客の保有する外国債券の為替リスクをヘッジするための先物外国為替取引や、社債発行時の金利リスクをヘッジするための金利スワップの提供等があります。最終利用者としては、当社の金融資産・負債に係る金利リスクをヘッジするために金利スワップを利用し、また、トレーディング・ポジションをヘッジするために各種先物取引、オプション取引等を利用しております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社はリスク管理の基本方針を定めた「リスク管理規程」を取締役会で決定しており、リスク管理の基本方針に基づき、各業務のリスク特性や規模に応じたリスク管理を行っております。

① トレーディング目的の金融商品に係るリスク管理

(i) 市場リスクの管理

当社のトレーディング業務では、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)、ポジション、感応度等に限度枠を設定しております。当社のリスク管理部では市場リスクの状況をモニタリングし、経営陣に日次で報告しております。

また、一定期間のデータに基づいて統計的仮定により算出したVaRの限界を補うべく、過去の大幅なマーケット変動に基づくシナリオや、仮想的なストレステストに基づくシナリオを用いて、ストレステストを実施しております。

<市場リスクに係る定量的情報>

当社では、トレーディング商品に関するVaRの算定にあたって、ヒストリカル・シミュレーション法(保有期間1日、信頼区間99%、観測期間520営業日)を採用しております。

決算日における当社のトレーディング業務のVaRは、全体で10億円です。

なお、当社では算出されたVaRと損益を比較するバックテストを実行し、モデルの有効性を検証しております。ただし、VaRは過去の相場変動をベースに統計的に算出しており、通常では考えられないほど市場環境が激変する状況下においてはリスクを十分に捕捉できない場合があります。

(ii) 信用リスクの管理

当社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、事前に取引先の格付等に基づく与信枠を設定し、当該与信枠の遵守状況をモニタリングしております。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は、クレジットスプレッドの変動リスクを中心にモニタリングしております。さらに、大口与信の影響についても定期的なモニタリングをしております。

信用取引においては顧客への与信が発生しますが、担保として定められた委託保証金を徴求しております。また、有価証券貸借取引については、取引先に対する与信枠を設定した上で、必要な担保を徴求するとともに日々の値洗い等を通じて信用リスクの削減を図っております。

② トレーディング目的以外の金融商品に係るリスク管理

当社はトレーディング業務以外に、取引関係上の目的等で投資有価証券等の金融商品を保有しております。取引関係上の目的等の投資有価証券等は、関連規程等に定められた方針に基づき取得・売却の決定を行います。また、定期的にリスクの状況をモニタリングしております。

<市場リスクに係る定量的情報>

市場リスクの影響を受ける主たる金融資産は、取引関係上の目的で保有する「投資有価証券」であります。なお、2018年3月31日現在、指標となる東証株価指数(TOPIX)等が10%変動したものと想定した場合には「投資有価証券」の内、時価のある株式等において時価が7億円変動するものと把握しております。

また、当社は金融商品を保有するとともに、社債、メディアム・ターム・ノート、金融機関借入、コマーシャル・ペーパー、コールマネー、現先取引、レポ取引等による資金調達を行っており、流動性リスクに晒されております。流動性リスクとは、市場環境の変化や当社の財務内容の悪化等により資金繰りに支障をきたす、あるいは通常よりも著しく高い調達コストを余儀なくされることにより損失を被るリスクを指します。

当社では、デリバティブ市場における仲介業者及び最終利用者としてデリバティブ取引を利用しております。デリバティブ商品は顧客の様々な金融ニーズに対応するための必要不可欠な商品となっており、仲介業者として顧客の要望に応じるために様々な形で金融商品を提供しております。例えば、顧客の保有する外国債券の為替リスクをヘッジするための先物外国為替取引や、社債発行時の金利リスクをヘッジするための金利スワップの提供等があります。最終利用者としては、当社の金融資産・負債に係る金利リスクをヘッジするために金利スワップを利用し、また、トレーディング・ポジションをヘッジするために各種先物取引、オプション取引等を利用しております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社はリスク管理の基本方針を定めた「リスク管理規程」を取締役会で決定しており、リスク管理の基本方針に基づき、各業務のリスク特性や規模に応じたリスク管理を行っております。

① トレーディング目的の金融商品に係るリスク管理

(i) 市場リスクの管理

当社のトレーディング業務では、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、バリュー・アット・リスク(一定の信頼水準のもとでの最大予想損失額。以下[VaR]という。)、ポジション、感応度等に限度枠を設定しております。当社のリスク管理部では市場リスクの状況をモニタリングし、経営陣に日次で報告しております。

また、一定期間のデータに基づいて統計的仮定により算出したVaRの限界を補うべく、過去の大幅なマーケット変動に基づくシナリオや、仮想的なストレステストに基づくシナリオを用いて、ストレステストを実施しております。

<市場リスクに係る定量的情報>

当社では、トレーディング商品に関するVaRの算定にあたって、ヒストリカル・シミュレーション法(保有期間1日、信頼区間99%、観測期間520営業日)を採用しております。

決算日における当社のトレーディング業務のVaRは、全体で9億円です。

なお、当社では算出されたVaRと損益を比較するバックテストを実行し、モデルの有効性を検証しております。ただし、VaRは過去の相場変動をベースに統計的に算出しており、通常では考えられないほど市場環境が激変する状況下においてはリスクを十分に捕捉できない場合があります。

(ii) 信用リスクの管理

当社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は、リスク量をモニタリングしています。さらに、大口与信の影響についても定期的なモニタリングをしております。

信用取引においては顧客への与信が発生しますが、担保として定められた委託保証金を徴求しております。また、有価証券貸借取引については、取引先に対する与信枠を設定した上で、必要な担保を徴求するとともに日々の値洗い等を通じて信用リスクの削減を図っております。

② トレーディング目的以外の金融商品に係るリスク管理

当社はトレーディング業務以外に、取引関係上の目的等で投資有価証券等の金融商品を保有しております。取引関係上の目的等の投資有価証券等は、関連規程等に定められた方針に基づき取得・売却の決定を行います。また、定期的にリスクの状況をモニタリングしております。

<市場リスクに係る定量的情報>

市場リスクの影響を受ける主たる金融資産は、取引関係上の目的で保有する「投資有価証券」であります。なお、2019年3月31日現在、指標となる東証株価指数(TOPIX)等が10%変動したものと想定した場合には「投資有価証券」の内、時価のある株式等において時価が2億円変動するものと把握しております。

また、市場リスクの影響を受ける主たる金融負債は「社債」及び「長期借入金」であります。なお、2018年3月31日現在、その他全てのリスク変数が一定であると仮定し、指標となる金利が10ベース・ポイント(0.1%)変動したものと想定した場合、「社債」の時価が1億円、「長期借入金」の時価が14億円それぞれ変動するものと把握しております。

③流動性の管理

当社は、多くの資産及び負債を用いて有価証券関連業務を中心としたビジネスを行っており、ビジネスを継続する上で十分な流動性を効率的かつ安定的に確保することを資金調達の基本方針としております。

当社の資金調達手段には、社債、メディアム・ターム・ノート、金融機関借入、コマーシャル・ペーパー、コールマネー等の無担保調達、現先取引、レポ取引等の有担保調達があり、これらの多様な調達手段を適切に組み合わせることにより、効率的かつ安定的な資金調達の実現を図っております。

財務の安定性という観点では、環境が大きく変動した場合においても、業務の継続に支障をきたすことのないよう、平時から安定的に資金を確保するよう努めております。特に近年においては、世界的金融危機及び信用危機による不測の事態に備え、市場からの資金調達、金融機関からの借入等により、手元流動性の更なる積み増しを行っております。同時に、危機発生等により、新規の資金調達及び既存資金の再調達が困難となる場合も想定し、調達資金の償還期限及び調達先の分散を図っております。

また、当社の親会社である大和証券グループ本社を中心とする大和証券グループでは、グループ全体での適正な流動性確保という基本方針の下、大和証券グループ本社が一元的に資金の流動性の管理・モニタリングを行っております。その中で当社は、一定期間内に期日が到来する無担保調達資金及び同期間にストレスが発生した場合の資金流出見込額に対し、様々なストレスシナリオを想定したうえで、それらをカバーする流動性ポートフォリオが保持されていることを日次で確認しております。

当社は、流動性リスクへの対応の一環として、コンティンジェンシー・ファンディング・プランを策定しております。同プランは、信用力の低下等の内生的要因や金融市場の混乱等の外生的要因によるストレスの逼迫度に応じた報告体制や資金調達手段の確保などの方針を定めており、これにより当社は機動的な対応により流動性を確保する態勢を整備しております。

当社のコンティンジェンシー・ファンディング・プランは、変動する金融環境に機動的に対応するため、定期的な見直しを行っております。

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額の他、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる条件等によった場合、当該価額が変動することもあります。

また、市場リスクの影響を受ける主たる金融負債は「社債」及び「長期借入金」であります。なお、2019年3月31日現在、その他全てのリスク変数が一定であると仮定し、指標となる金利が10ベース・ポイント(0.1%)変動したものと想定した場合、「社債」の時価が1億円、「長期借入金」の時価が12億円それぞれ変動するものと把握しております。

③流動性の管理

当社は、多くの資産及び負債を用いて有価証券関連業務を中心としたビジネスを行っており、ビジネスを継続する上で十分な流動性を効率的かつ安定的に確保することを資金調達の基本方針としております。

当社の資金調達手段には、社債、メディアム・ターム・ノート、金融機関借入、コマーシャル・ペーパー、コールマネー等の無担保調達、現先取引、レポ取引等の有担保調達があり、これらの多様な調達手段を適切に組み合わせることにより、効率的かつ安定的な資金調達の実現を図っております。

財務の安定性という観点では、環境が大きく変動した場合においても、業務の継続に支障をきたすことのないよう、平時から安定的に資金を確保するよう努めると同時に、危機発生等により、新規の資金調達及び既存資金の再調達が困難となる場合も想定し、調達資金の償還期限及び調達先の分散を図っております。

また、当社の親会社である大和証券グループ本社を中心とする大和証券グループでは、グループ全体での適正な流動性確保という基本方針の下、大和証券グループ本社が一元的に資金の流動性の管理・モニタリングを行っております。その中で当社は、一定期間内に期日が到来する無担保調達資金及び同期間にストレスが発生した場合の資金流出見込額に対し、様々なストレスシナリオを想定したうえで、それらをカバーする流動性ポートフォリオが保持されていることを日次で確認しております。

当社は、流動性リスクへの対応の一環として、コンティンジェンシー・ファンディング・プランを策定しております。同プランは、信用力の低下等の内生的要因や金融市場の混乱等の外生的要因によるストレスの逼迫度に応じた報告体制や資金調達手段の確保などの方針を定めており、これにより当社は機動的な対応により流動性を確保する態勢を整備しております。

当社のコンティンジェンシー・ファンディング・プランは、変動する金融環境に機動的に対応するため、定期的な見直しを行っております。

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額の他、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる条件等によった場合、当該価額が変動することもあります。

2018年3月期

2. 金融商品の時価等に関する事項

2018年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません((注2)に記載のとおりであります)。

(単位:百万円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	1,314,548	1,314,548	-
(2) 預託金	327,069	327,069	-
(3) トレーディング商品			
① 商品有価証券等	2,668,054	2,668,054	-
② デリバティブ取引	2,495,153	2,495,153	-
(4) 信用取引資産			
信用取引貸付金	224,933	224,933	-
信用取引借証券担保金	31,453	31,453	-
(5) 有価証券担保貸付金			
借入有価証券担保金	3,686,573	3,686,573	-
現先取引貸付金	125,353	125,353	-
(6) 短期差入保証金	307,890	307,890	-
(7) 短期貸付金	320,901	320,901	-
(8) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	10,504	10,504	-
資産計	11,512,435	11,512,435	-
(1) トレーディング商品			
① 商品有価証券等	1,651,658	1,651,658	-
② デリバティブ取引	2,198,787	2,198,787	-
(2) 約定見返勘定	329,873	329,873	-
(3) 信用取引負債			
信用取引借入金	2,347	2,347	-
信用取引貸証券受入金	68,251	68,251	-
(4) 有価証券担保借入金			
有価証券貸借取引受入金	1,724,185	1,724,185	-
現先取引借入金	1,196,088	1,196,088	-
(5) 預り金	220,041	220,041	-
(6) 受入保証金	413,997	413,997	-
(7) 短期借入金	1,242,432	1,242,432	-
(8) コマーシャル・ペーパー	105,000	105,000	-
(9) 1年内償還予定の社債	185,558	185,558	-
(10) 社債	583,323	584,679	△1,355
(11) 長期借入金	838,156	841,600	△3,444
負債計	10,759,702	10,764,501	△4,799

(注1) 金融商品の時価の算定方法

(ア) 現金・預金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(イ) 預託金

主に顧客分別金信託で構成され、国債等の有価証券投資を行っているものについては類似の債券を含めた直前の取引値段から計算される各期間に応じた指標金利との利回り格差を用いて合理的に算出する価格に基づいて算定しております。その他運用商品については、短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(ウ) トレーディング商品

① 商品有価証券等

株式等	主たる取引所の最終価格又は最終気配値
債券	主に類似の債券を含めた直前の取引値段(当社店頭、ブローカースクリーン等)や市場価格情報(売買参考統計値等)から、指標金利との格差等を用いて、合理的に算定される価格
受益証券	取引所の最終価格若しくは最終気配値又は基準価額

2019年3月期

2. 金融商品の時価等に関する事項

2019年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません((注2)に記載のとおりであります)。

(単位:百万円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	1,436,026	1,436,026	-
(2) 預託金	304,071	304,071	-
(3) トレーディング商品			
① 商品有価証券等	1,658,180	1,658,180	-
② デリバティブ取引	2,927,453	2,927,453	-
(4) 約定見返勘定	196,596	196,596	-
(5) 信用取引資産			
信用取引貸付金	153,579	153,579	-
信用取引借証券担保金	17,544	17,544	-
(6) 有価証券担保貸付金			
借入有価証券担保金	1,260,457	1,260,457	-
現先取引貸付金	897,413	897,413	-
(7) 短期差入保証金	386,976	386,976	-
(8) 短期貸付金	409,872	409,872	-
(9) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	4,628	4,628	-
資産計	9,652,800	9,652,800	-
(1) トレーディング商品			
① 商品有価証券等	894,801	894,801	-
② デリバティブ取引	2,699,126	2,699,126	-
(2) 信用取引負債			
信用取引借入金	2,536	2,536	-
信用取引貸証券受入金	66,076	66,076	-
(3) 有価証券担保借入金			
有価証券貸借取引受入金	305,127	305,127	-
現先取引借入金	1,452,218	1,452,218	-
(4) 預り金	223,495	223,495	-
(5) 受入保証金	367,144	367,144	-
(6) 短期借入金	1,263,723	1,263,723	-
(7) コマーシャル・ペーパー	100,000	100,000	-
(8) 1年内償還予定の社債	129,123	129,123	-
(9) 社債	626,243	627,462	△1,219
(10) 長期借入金	830,453	836,191	△5,737
負債計	8,960,071	8,967,028	△6,957

(注1) 金融商品の時価の算定方法

(ア) 現金・預金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(イ) 預託金

主に顧客分別金信託で構成され、国債等の有価証券投資を行っているものについては類似の債券を含めた直前の取引値段から計算される各期間に応じた指標金利との利回り格差を用いて合理的に算出する価格に基づいて算定しております。その他運用商品については、短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(ウ) トレーディング商品

① 商品有価証券等

株式等	主たる取引所の最終価格又は最終気配値
債券	主に類似の債券を含めた直前の取引値段(当社店頭、ブローカースクリーン等)や市場価格情報(売買参考統計値等)から、指標金利との格差等を用いて、合理的に算定される価格
受益証券	取引所の最終価格若しくは最終気配値又は基準価額

②デリバティブ取引

取引所取引の デリバティブ取引	主に取引所の清算値段又は証拠金算定基準値段
金利スワップ取引等	イールドカーブより算出される予想キャッシュ・フロー、原債券の価格・クーポンレート、金利、ディスカウントレート、ボラティリティ、コリレーション等を基に、価格算定モデル(市場で一般に認識されているモデル若しくはこれらを拡張したモデル)により算出した価格
店頭エクイティ・ デリバティブ取引	株価又は株価指数、金利、配当、ボラティリティ、ディスカウントレート、コリレーション等を用いて、価格算定モデル(市場で一般に認識されているモデル若しくはこれらを拡張したモデル)により算出した価格
クレジット・ デリバティブ取引	金利、参照先の信用スプレッド等を用いて、価格算定モデル(市場で一般に認識されているモデル若しくはこれらを拡張したモデル)により算出した価格

なお、店頭デリバティブ取引については、取引相手先の信用リスク相当額及び流動性リスク相当額を必要に応じて時価に追加しております。

(エ)約定見返勘定

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(オ)信用取引資産、信用取引負債

信用取引資産は顧客の信用取引に伴う顧客への貸付金と証券金融会社への担保金であり、前者は顧客の意思による反対売買等により決済が行われ、後者は貸借取引業務において値洗いされる担保金であることから、短期間で決済されるとみなして帳簿価額を時価としております。

信用取引負債は顧客の信用取引に伴う証券金融会社からの借入金と顧客の信用取引に係る有価証券の売付代金相当額であり、前者は値洗いされ、後者は顧客の意思による反対売買等により決済が行われることから、短期間で決済されるとみなして帳簿価額を時価としております。

(カ)有価証券担保貸付金、有価証券担保借入金

これらは、そのほとんどが短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(キ)短期差入保証金、受入保証金

主としてデリバティブ取引における保証金であり、取引に応じて値洗いされる特性から、短期間で決済されるとみなして帳簿価額を時価としております。その他の顧客からの保証金については、当期末に決済された場合の支払額(帳簿価額)を時価とみなしております。

(ク)短期貸付金

主に当社顧客から保護預かりしている有価証券を担保として金銭を貸付する証券担保ローンや関係会社への貸付であり、返済見込期間及び金利条件等から、時価は帳簿価額と近似しているものと想定されるため、帳簿価額を時価としております。

(ケ)有価証券及び投資有価証券

株式等	主たる取引所の最終価格又は最終気配値
債券	主に類似の債券を含めた直前の取引値段(当社店頭、ブローカースクリーン等)や市場価格情報(売買参考統計値等)から、指標金利との格差等を用いて、合理的に算定される価格、又は裏付資産の価値から合理的に算定される価格
譲渡性預金	類似の商品を含めた直前の取引値段(当社店頭、ブローカースクリーン等)と計算される各期間に応じた指標金利(主要短期金利等のイールドカーブ)との利回り格差(クレジット格差や需給関係を反映したものを)を用いて算出した価格

(コ)預り金

主として顧客から受け入れている預り金であり、当期末に決済された場合の支払額(帳簿価額)を時価とみなしております。その他の預り金については短期間に支払いが行われるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(サ)短期借入金、コマーシャル・ペーパー、1年内償還予定の社債

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

②デリバティブ取引

取引所取引の デリバティブ取引	主に取引所の清算値段又は証拠金算定基準値段
金利スワップ取引等	イールドカーブより算出される予想キャッシュ・フロー、原債券の価格・クーポンレート、金利、ディスカウントレート、ボラティリティ、コリレーション等を基に、価格算定モデル(市場で一般に認識されているモデル若しくはこれらを拡張したモデル)により算出した価格
店頭エクイティ・ デリバティブ取引	株価又は株価指数、金利、配当、ボラティリティ、ディスカウントレート、コリレーション等を用いて、価格算定モデル(市場で一般に認識されているモデル若しくはこれらを拡張したモデル)により算出した価格
クレジット・ デリバティブ取引	金利、参照先の信用スプレッド等を用いて、価格算定モデル(市場で一般に認識されているモデル若しくはこれらを拡張したモデル)により算出した価格

なお、店頭デリバティブ取引については、取引相手先の信用リスク相当額及び流動性リスク相当額を必要に応じて時価に追加しております。

(エ)約定見返勘定

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(オ)信用取引資産、信用取引負債

信用取引資産は顧客の信用取引に伴う顧客への貸付金と証券金融会社への担保金であり、前者は顧客の意思による反対売買等により決済が行われ、後者は貸借取引業務において値洗いされる担保金であることから、短期間で決済されるとみなして帳簿価額を時価としております。

信用取引負債は顧客の信用取引に伴う証券金融会社からの借入金と顧客の信用取引に係る有価証券の売付代金相当額であり、前者は値洗いされ、後者は顧客の意思による反対売買等により決済が行われることから、短期間で決済されるとみなして帳簿価額を時価としております。

(カ)有価証券担保貸付金、有価証券担保借入金

これらは、そのほとんどが短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(キ)短期差入保証金、受入保証金

主としてデリバティブ取引における保証金であり、取引に応じて値洗いされる特性から、短期間で決済されるとみなして帳簿価額を時価としております。その他の顧客からの保証金については、当期末に決済された場合の支払額(帳簿価額)を時価とみなしております。

(ク)短期貸付金

主に当社顧客から保護預かりしている有価証券を担保として金銭を貸付する証券担保ローンや関係会社への貸付であり、返済見込期間及び金利条件等から、時価は帳簿価額と近似しているものと想定されるため、帳簿価額を時価としております。

(ケ)有価証券及び投資有価証券

株式等	主たる取引所の最終価格又は最終気配値
債券	主に類似の債券を含めた直前の取引値段(当社店頭、ブローカースクリーン等)や市場価格情報(売買参考統計値等)から、指標金利との格差等を用いて、合理的に算定される価格、又は裏付資産の価値から合理的に算定される価格
譲渡性預金	類似の商品を含めた直前の取引値段(当社店頭、ブローカースクリーン等)と計算される各期間に応じた指標金利(主要短期金利等のイールドカーブ)との利回り格差(クレジット格差や需給関係を反映したものを)を用いて算出した価格

(コ)預り金

主として顧客から受け入れている預り金であり、当期末に決済された場合の支払額(帳簿価額)を時価とみなしております。その他の預り金については短期間に支払いが行われるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(サ)短期借入金、コマーシャル・ペーパー、1年内償還予定の社債

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

2018年3月期

(シ)社債

償還まで1年超の社債の時価について、市場価格(売買参考統計値等)が入手可能な場合には、その時価を市場価格から算定しております。市場価格が入手不可能な場合は、発行時からの金利変動及び当社自身の信用スプレッドの変動相当額を、帳簿価額に調整することによって算定しております。当社自身の信用スプレッドについては、直近の調達レート、自社発行の類似債券の市場価格水準等を参照しております。

(ス)長期借入金

借入当初からの金利変動及び信用スプレッドの変動相当額を、帳簿価額に調整することによって算定しております。当社自身の信用スプレッドについては、直近の調達レート、自社発行の類似債券の市場価格水準等を参照しております。

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品は次のとおりであり、資産(8)「その他有価証券」には含まれておりません。

(単位：百万円)	
区分	貸借対照表計上額
子会社株式及び関連会社株式	
非上場株式	1,135
その他有価証券	
非上場株式	3,015
投資事業有限責任組合及びそれに類する組合等への出資	2,380
その他	1,544

(注)市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから時価開示の対象とはしておりません。

2019年3月期

(シ)社債

償還まで1年超の社債の時価について、市場価格(売買参考統計値等)が入手可能な場合には、その時価を市場価格から算定しております。市場価格が入手不可能な場合は、発行時からの金利変動及び当社自身の信用スプレッドの変動相当額を、帳簿価額に調整することによって算定しております。当社自身の信用スプレッドについては、直近の調達レート、自社発行の類似債券の市場価格水準等を参照しております。

(ス)長期借入金

借入当初からの金利変動及び信用スプレッドの変動相当額を、帳簿価額に調整することによって算定しております。当社自身の信用スプレッドについては、直近の調達レート、自社発行の類似債券の市場価格水準等を参照しております。

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品は次のとおりであり、資産(9)「その他有価証券」には含まれておりません。

(単位：百万円)	
区分	貸借対照表計上額
子会社株式及び関連会社株式	
非上場株式	1,135
その他有価証券	
非上場株式	3,006
投資事業有限責任組合及びそれに類する組合等への出資	1,314
その他	1,506

(注)市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから時価開示の対象とはしておりません。

持分法損益等

1. 関連会社に関する事項

当社が有しているすべての関連会社は、利益基準及び利益剰余金基準からみて重要性の乏しい関連会社であるため、記載を省略しております。

2. 開示対象特別目的会社に関する事項

開示対象特別目的会社の概要及び開示対象特別目的会社を利用した取引の概要等

当社は、顧客の資金運用ニーズに応える目的で仕組債を販売しており、仕組債の組成に際し特別目的会社を利用しております。この取引において、当社は、取得した債券をケイマン法人の特別目的会社に譲渡し、当該特別目的会社は取得した債券を担保とする仕組債を発行しております。当該特別目的会社は7社ですが、いずれの特別目的会社についても、当社は議決権のある出資等は有しておらず、役員や従業員の派遣もありません。なお、当期末における特別目的会社の債券の発行額は589,152百万円であります。

1. 関連会社に関する事項

当社が有しているすべての関連会社は、利益基準及び利益剰余金基準からみて重要性の乏しい関連会社であるため、記載を省略しております。

2. 開示対象特別目的会社に関する事項

開示対象特別目的会社の概要及び開示対象特別目的会社を利用した取引の概要等

当社は、顧客の資金運用ニーズに応える目的で仕組債を販売しており、仕組債の組成に際し特別目的会社を利用しております。この取引において、当社は、取得した債券をケイマン法人の特別目的会社に譲渡し、当該特別目的会社は取得した債券を担保とする仕組債を発行しております。当該特別目的会社は8社ですが、いずれの特別目的会社についても、当社は議決権のある出資等は有しておらず、役員や従業員の派遣もありません。なお、当期末における特別目的会社の債券の発行額は621,348百万円であります。

関連当事者との取引に関する注記

1. 親会社及び法人主要株主等

(単位：百万円)

種類	会社等の名称	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社	株式会社大和証券グループ本社	被所有直接100%	資金の借入等 役員の兼任	資金の借入(注)	596,470	短期借入金	343,432
				利息の支払(注)	8,215	長期借入金	421,616
						未払費用	2,164

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注)取引金額には、短期借入金は月末平均残高、長期借入金は借入金額を記載しております。

また、資金の借入については、市場金利を勘案して決定しております。

1. 親会社及び法人主要株主等

(単位：百万円)

種類	会社等の名称	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社	株式会社大和証券グループ本社	被所有直接100%	資金の借入等 役員の兼任	資金の借入(注)	359,223	短期借入金	339,923
				利息の支払(注)	10,941	長期借入金	415,653
						未払費用	2,372

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注)取引金額には、短期借入金は月末平均残高、長期借入金は借入金額を記載しております。

また、資金の借入については、市場金利を勘案して決定しております。

2018年3月期

2. 兄弟会社等

(単位：百万円)

種類	会社等の名称	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	大和証券キャピタル・マーケットヨーロッパパリミテッド	なし	証券取引等	有価証券貸借取引(注1,2)	-	有価証券担保貸付金	3,700
				有価証券貸借取引収益(注2)	79	有価証券担保借入金	596,241
				有価証券貸借取引費用(注2)	880		
				資金の貸付(注2,3)	137,533	短期貸付金	166,265
				利息の受取(注2)	2,458	未収収益	762
				有価証券の購入、売却(注1,2)	-	-	-
				デリバティブ取引(注1,2)	-	デリバティブ取引(資産)	31,468
		デリバティブ取引(負債)	40,002				
親会社の子会社	大和証券キャピタル・マーケットアメリカInc.	なし	証券取引等	有価証券貸借取引(注1,2)	-	有価証券担保貸付金	120,123
				有価証券貸借取引収益(注2)	198	有価証券担保借入金	537,611
				有価証券貸借取引費用(注2)	7,705		
				有価証券の購入、売却(注1,2)	-	-	-
親会社の子会社	大和証券投資信託委託株式会社	なし	投資信託に係る事務代行役員の兼任	投資信託の代理事務手数料等(注4)	23,126	未収収益	3,913

2019年3月期

2. 兄弟会社等

(単位：百万円)

種類	会社等の名称	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	大和証券キャピタル・マーケットヨーロッパパリミテッド	なし	証券取引等	有価証券貸借取引(注1,2)	-	有価証券担保貸付金	500
				有価証券貸借取引収益(注2)	109	有価証券担保借入金	172,697
				有価証券貸借取引費用(注2)	968		
				資金の貸付(注2,3)	201,753	短期貸付金	243,623
				利息の受取(注2)	5,633	未収収益	2,162
				有価証券の購入、売却(注1,2)	-	-	-
				デリバティブ取引(注1,2)	-	デリバティブ取引(資産)	43,595
		デリバティブ取引(負債)	47,860				
親会社の子会社	大和証券キャピタル・マーケットアメリカInc.	なし	証券取引等	有価証券貸借取引(注1,2)	-	有価証券担保貸付金	65,812
				有価証券貸借取引収益(注2)	879	有価証券担保借入金	278,933
				有価証券貸借取引費用(注2)	11,608		
				有価証券の購入、売却(注1,2)	-	-	-
親会社の子会社	大和証券投資信託委託株式会社	なし	投資信託に係る事務代行役員の兼任	投資信託の代理事務手数料等(注4)	19,975	未収収益	3,400

2018年3月期

(単位：百万円)

種類	会社等の名称	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	株式会社大和ネクスト銀行	なし	証券取引等 役員の兼任	有価証券貸借取引 (注1,2)	-	有価証券担保貸付金	121,373
				有価証券貸借取引収益 (注2)	1,488		
				有価証券の購入、売却 (注1,2)	-	-	-
				デリバティブ取引 (注1,2)	-	デリバティブ取引(資産) デリバティブ取引(負債)	188 91

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 反復的取引であるため取引金額の記載を省略しております。

(注2) 当該取引条件は、市場実勢を勘案して決定しております。

(注3) 取引金額には、貸付金の月末平均残高を記載しております。

(注4) 各投資信託の信託約款に基づいております。当社が受取る手数料は他の販売会社と同様に決定しております。

3. 役員及びその近親者等

該当する事項はありません。

2019年3月期

(単位：百万円)

種類	会社等の名称	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	株式会社大和ネクスト銀行	なし	証券取引等 役員の兼任	有価証券貸借取引 (注1,2)	-	有価証券担保貸付金	22,236
				有価証券貸借取引収益 (注2)	1,890		
				有価証券の購入、売却 (注1,2)	-	-	-
				デリバティブ取引 (注1,2)	-	デリバティブ取引(資産) デリバティブ取引(負債)	868 173

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 反復的取引であるため取引金額の記載を省略しております。

(注2) 当該取引条件は、市場実勢を勘案して決定しております。

(注3) 取引金額には、貸付金の月末平均残高を記載しております。

(注4) 各投資信託の信託約款に基づいております。当社が受取る手数料は他の販売会社と同様に決定しております。

3. 役員及びその近親者等

該当する事項はありません。

1株当たり情報に関する注記

1. 1株当たり純資産額	988,672円20銭
2. 1株当たり当期純利益	79,531円48銭

1. 1株当たり純資産額	953,198円18銭
2. 1株当たり当期純利益	47,269円49銭

重要な後発事象に関する注記

該当事項はありません。

該当事項はありません。

借入金の主要な借入先及び借入金額

(単位：百万円)

借入先	借入金額
株式会社大和証券グループ本社	765,048
日本銀行	10,000

(単位：百万円)

借入先	借入金額
株式会社大和証券グループ本社	755,577
日本銀行	250,000

2018年3月期

2019年3月期

保有する有価証券(トレーディング商品に属するものとして経理された有価証券を除く)の取得価額、時価及び評価損益

1. 時価のあるもの

(単位：百万円)

	取得価格	時価	評価損益
1. 流動資産	-	-	-
(1) 株券	-	-	-
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	-	-	-
2. 固定資産	4,245	10,504	6,259
(1) 株券	1,245	7,504	6,259
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	3,000	3,000	-
合計	4,245	10,504	6,259

2. 時価のないもの

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
1. 流動資産	-
(1) 株券	-
(2) 債券	-
(3) その他	-
2. 固定資産	8,074
(1) 株券	4,150
(2) 債券	-
(3) その他	3,924
合計	8,074

1. 時価のあるもの

(単位：百万円)

	取得価格	時価	評価損益
1. 流動資産	1,000	1,000	-
(1) 株券	-	-	-
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	1,000	1,000	-
2. 固定資産	1,034	3,628	2,594
(1) 株券	1,034	3,628	2,594
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	-	-	-
合計	2,034	4,628	2,594

2. 時価のないもの

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
1. 流動資産	-
(1) 株券	-
(2) 債券	-
(3) その他	-
2. 固定資産	6,963
(1) 株券	4,141
(2) 債券	-
(3) その他	2,821
合計	6,963

デリバティブ取引(トレーディング商品に属するものとして経理された取引を除く)の契約価額、時価及び評価損益

該当事項はありません。

該当事項はありません。

財務諸表に関する監査法人等による監査の有無

当社は、会社法第436条第2項第1号の規定に基づき同法第435条第2項に定められた計算書類及びその附属明細書について、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

当社は、会社法第436条第2項第1号の規定に基づき同法第435条第2項に定められた計算書類及びその附属明細書について、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

金融商品取引法第43条の2の規定に基づく分別管理の状況

(1) 顧客分別金信託の状況

(単位：百万円)

項目	2018年3月31日 現在	2019年3月31日 現在
直近差替計算基準日の顧客分別金必要額	255,907	244,427
顧客分別金信託額	282,000	269,001
期末日現在の顧客分別金必要額	240,383	241,056

(2) 有価証券の分別管理の状況

①保護預り等有価証券

有価証券の種類	2018年3月31日現在		2019年3月31日現在	
	国内証券	外国証券	国内証券	外国証券
株券	52,015,334 千株	1,553,456 千株	51,068,175 千株	1,779,112 千株
債券	8,359,463 百万円	4,876,785 百万円	9,606,614 百万円	4,674,346 百万円
受益証券	9,380,986 百万口	125,165 百万口	8,960,204 百万口	122,822 百万口
その他 (新株予約権証券)	368個	28,881個	68個	100,184個
その他 (受益証券発行信託の受益証券)	7,107 百万円	-	6,114 百万円	-

(※) 上記有価証券には、市場性のない有価証券を含んでおります。

②受入保証金代用有価証券

有価証券の種類	2018年3月31日現在	2019年3月31日現在
	数量	数量
株券	259,262千株	242,124千株
債券	27,225百万円	35,935百万円
受益証券	91,271百万口	87,068百万口
その他 (受益証券発行信託の受益証券)	692百万円	644百万円

③管理の状況

お客様よりお預りしている有価証券は、総合取引約款等に基づく下記の管理形態で『分別管理』しております。

有価証券種類	当社の管理形態 (2019年3月31日現在)
国内証券 ・株券 ・債券 ・投資信託受益証券等 ・新株予約権証券等	「社債、株式等の振替に関する法律」に基づく振替決済制度において取扱う振替株式等の有価証券は、口座管理機関として振替口座簿により管理しております。上記以外の保護預り証券は、当社においてお客様ごとに保管しております。
外国証券	国内の取引所取引に係る外国証券は、株式会社証券保管振替機構において、また、外国の金融商品取引市場等の取引に係る外国証券は、国別に選定した海外保管機関において混蔵して保管されております(現地保管機関の国内の諸法令及び慣行に従って保管しております)。お客様個々のお預り分につきましては、帳簿によって判別できるように管理しております。

有価証券種類	当社の管理形態 (2019年3月31日現在)
積立投資	「社債、株式等の振替に関する法律」に基づく振替決済制度において取扱う国内投資信託の受益権は、口座管理機関として振替口座簿により管理しております。お客様個々のお預り分につきましては、帳簿によって判別できるように管理しております。
株式累積投資	有価証券の種別に応じて上記同様の管理をしております。お客様個々の持分につきましては、帳簿によって判別できるように管理しております。

金融商品取引法第43条の3の規定に基づく区分管理の状況

(1) 法第43条の3第1項の規定に基づく区分管理の状況

	管理の方法	2018年3月31日 現在	2019年3月31日 現在	内 訳
金銭	金銭信託	20,000百万円	20,000百万円	三井住友銀行
金銭	金銭信託	20,993百万円	12,493百万円	三井住友信託銀行
有価証券等	第三者による管理	10,644千株	13,353千株	証券保管振替機構
有価証券等	第三者による管理	10百万円	10百万円	日本銀行
有価証券等	第三者による管理	2,389百万円	3,308百万円	証券保管振替機構
有価証券等	第三者による管理	11,839百万口	17,128百万口	証券保管振替機構
有価証券等	第三者による管理	84千株	92千株	CitibankNY (米国)
有価証券等	第三者による管理	31,288百万円	40,101百万円	Euroclear Bank(ベルギー)
有価証券等	第三者による管理	-	281百万円	Daiwa Capital Markets America (米国)
有価証券等	第三者による管理	25百万円	-	CitibankNY (米国)
有価証券等	第三者による管理	68百万口	135百万口	受託銀行(英国)

(※) 有価証券等については、有価証券関連以外のデリバティブ取引のみに関して預託を受けた有価証券を報告致します。

(2) 法第43条の3第2項の規定に基づく区分管理の状況

該当ありません。

(※) 法第43条の3第1項及び第2項に基づく区分管理に関する金銭信託は、合算で信託しております。

連結子会社等の状況に関する事項(2019年3月31日現在)

(1) 企業集団の構成

該当ありません。

(2) 子会社等の商号又は名称、本店又は主たる事務所の所在地、資本金の額、事業の内容等

該当ありません。

大和証券 国内サービス網

本店その他の営業所又は事務所の名称及び所在地 (2019年7月1日現在)

店舗名	住所	電話番号	店舗名	住所	電話番号
本店	東京都千代田区丸の内1丁目9番1号 (グラントウキョウノースタワー18F)	(03) 5555-7555	新小岩営業所	東京都葛飾区西新小岩1丁目9番7号 (ガルデニア福島2F)	(03) 4431-8380
北海道・東北地区			五反田支店	東京都品川区西五反田1丁目1番8号	(03) 3493-1211
札幌支店	北海道札幌市中央区大通西3丁目7番地 (北洋大通センター2F)	(011) 214-6111	武蔵小山営業所	東京都品川区小山4丁目4番7号 (コスモ武蔵小山ビル8F)	(03) 4412-1080
釧路支店	北海道釧路市北大通1丁目1番地2	(0154) 23-0161	自由が丘支店	東京都目黒区自由が丘2丁目12番15号	(03) 3717-0141
青森支店	青森県青森市新町2丁目5番13号	(017) 777-2111	学芸大学営業所	東京都目黒区鷹番2丁目20番6号 (タシロビル4F)	(03) 4487-4080
盛岡支店	岩手県盛岡市菜園1丁目12番10号	(019) 652-1171	浦田支店	東京都大田区西浦田7丁目45番6号	(03) 3732-9171
仙台支店	宮城県仙台市青葉区中央2丁目8番13号	(022) 221-5111	大森支店	東京都大田区大森北1丁目5番1号	(03) 5471-3311
秋田支店	秋田県秋田市中通4丁目5番2号	(018) 831-2811	成城支店	東京都世田谷区成城2丁目34番12号	(03) 3415-5211
山形支店	山形県山形市本町2丁目4番9号	(023) 622-8151	経堂営業所	東京都世田谷区宮坂3丁目10番9号 (経堂フコク生命ビル2F)	(03) 3415-4173
福島支店	福島県福島市栄町11番25号	(024) 522-3111	向ヶ丘遊園営業所	神奈川県川崎市多摩区登戸2043番地 (小田急マルシェ向ヶ丘2 3F)	(03) 4416-3260
郡山支店	福島県郡山市中町10番10号	(024) 932-3111	渋谷支店	東京都渋谷区神南1丁目23番14号	(03) 3463-9211
いわき支店	福島県いわき市平字田町1番地の7	(0246) 23-0111	用賀営業所	東京都世田谷区用賀4丁目10番1号 (世田谷ビジネススクエアタワーB1F)	(03) 4323-8650
関東地区			代々木上原営業所	東京都渋谷区西原3丁目12番14号 (西原ビル3F)	(03) 4323-8630
水戸支店	茨城県水戸市泉町2丁目3番2号	(029) 226-9111	三軒茶屋営業所	東京都世田谷区太子堂2丁目16番5号 (さいとうビル4F)	(03) 4323-8640
宇都宮支店	栃木県宇都宮市本町13番18号	(028) 621-3531	中野支店	東京都中野区中野2丁目30番5号	(03) 5385-1311
高崎支店	群馬県高崎市八島町58番1号	(027) 327-7111	池袋支店	東京都豊島区西池袋1丁目11番1号 (メトロポリタンプラザビル18F)	(03) 3982-2141
伊勢崎営業所	群馬県伊勢崎市中央町22番5号 (中央ビルメゾン石坂2F)	(027) 338-6120	成増営業所	東京都板橋区成増1丁目30番13号 (トーセイ三井生命ビル2F)	(03) 4354-0280
前橋営業所	群馬県前橋市表町2丁目2番6号 (前橋ファーストビルディング8F)	(027) 338-6130	ひばりヶ丘営業所	東京都西東京市ひばりが丘北3-5-19 (カマタビル3F)	(03) 4354-2800
大宮支店	埼玉県さいたま市大宮区宮町1丁目89番地	(048) 642-3881	ときわ台営業所	東京都板橋区常盤台1丁目2番1号 (常盤台IGビル2F)	(03) 4354-2810
春日部営業所	埼玉県春日部市中央1丁目51番地1 (春日部大栄ビル5F)	(048) 642-3714	池袋西口支店	東京都豊島区池袋2丁目2番地1号	(03) 3980-1005
久喜営業所	埼玉県久喜市久喜中央1丁目1番20号 (クッキープラザ5F)	(048) 637-3480	赤羽支店	東京都北区赤羽1丁目9番5号	(03) 3903-0311
浦和支店	埼玉県さいたま市浦和区高砂2丁目14番18号	(048) 834-6111	練馬支店	東京都練馬区豊玉北5丁目17番13号	(03) 3992-0131
川口支店	埼玉県川口市本町4丁目2番1号	(048) 225-3611	石神井公園営業所	東京都練馬区石神井町3丁目27番23号 (ガイア石神井公園ビル5F)	(03) 6367-3220
所沢支店	埼玉県所沢市東町12番12号	(04) 2922-8111	千住支店	東京都足立区千住2丁目26番	(03) 3879-6111
花小金井営業所	東京都小平市花小金井南町1丁目18番14号 (グラン・フルール1F)	(04) 2907-3510	草加営業所	埼玉県草加市高砂2丁目9番1号 (草加マルイ6F)	(03) 4434-2160
千葉支店	千葉県千葉市中央区富士見2丁目2番3号	(043) 227-8181	吉祥寺支店	東京都武蔵野市吉祥寺本町2丁目1番10号	(0422) 22-9311
五井営業所	千葉県市原市五井中央西2丁目8番33号 (小宮ビル5F)	(043) 394-7100	永福町営業所	東京都杉並区和泉3丁目6番2号 (プラムビル3F)	(0422) 57-3660
船橋支店	千葉県船橋市本町4丁目40番22号	(047) 424-2111	府中支店	東京都府中市府中町1丁目1番地の5	(042) 354-7000
海浜幕張営業所	千葉県千葉市美浜区中瀬2丁目6番1号 (ワールドビジネスガーデン・アトリウム2F)	(047) 419-3890	国立支店	東京都国立市東1丁目4番地11	(042) 571-0211
松戸支店	千葉県松戸市本町19番地15	(047) 366-5111	立川支店	東京都立川市曙町2丁目7番16号	(042) 526-1711
うすい支店	千葉県佐倉市王子台1丁目28番地8	(043) 462-1009	八王子支店	東京都八王子市旭町8番10号	(042) 644-2211
柏支店	千葉県柏市柏2丁目2番4号	(04) 7166-2701	多摩支店	東京都多摩市関戸1丁目7番地5 (京王聖蹟桜ヶ丘ショッピングセンターC館2F)	(042) 375-5511
浦安営業所	千葉県浦安市当代島1丁目3番27号 (イワオビル2F)	(03) 4531-2120	町田支店	東京都町田市原町田6丁目12番20号	(042) 722-2131
日比谷支店	東京都千代田区内幸町2丁目2番2号	(03) 3508-8111	横浜支店	神奈川県横浜市中区尾上町2丁目20番地	(045) 671-6700
銀座支店	東京都中央区銀座6-10-1 (GINZA SIX7F)	(03) 3572-2801	横浜西口支店	神奈川県横浜西区南幸1丁目11番1号	(045) 311-1271
新宿支店	東京都新宿区新宿3丁目30番11号	(03) 3352-5141	日吉営業所	神奈川県横浜市港北区日吉本町1丁目4番1号 (龜山ビル1F)	(045) 614-6150
山川営業所	東京都調布市山川町1丁目11番地12 (山川山本ビル2F)	(03) 4316-7500	センター南営業所	神奈川県横浜市都筑区茅ヶ崎中央44-11 (センター南駅前ビル4F)	(045) 614-6160
阿佐ヶ谷営業所	東京都杉並区阿佐ヶ谷南3丁目31番13号 (稲葉ビル2F)	(03) 4316-7520	二俣川営業所	神奈川県横浜市旭区二俣川2丁目50番14号 (コブレ二俣川オフィス9F)	(045) 614-6170
新宿センタービル支店	東京都新宿区西新宿1丁目25番1号 (新宿センタービルB1F)	(03) 3345-1661	戸塚支店	神奈川県横浜市戸塚区戸塚町4100番地	(045) 864-1715
上野支店	東京都台東区上野2丁目13番10号	(03) 3832-0191	青葉台支店	神奈川県横浜市青葉区青葉台2丁目9番2号	(045) 983-8282
亀戸支店	東京都江東区亀戸2丁目22番17号	(03) 3681-3181			
市川営業所	千葉県市川市市川1丁目3番18号 (SRビル市川2F)	(03) 3681-3304			

店舗名	住所	電話番号
鷺沼営業所	神奈川県川崎市宮前区鷺沼3丁目5番28号 (アグリアス鷺沼1F)	(045)517-9220
相模原支店	神奈川県相模原市中央区 相模原1丁目2番17号	(042)730-7000
川崎支店	神奈川県川崎市川崎区駅前本町12番地1	(044)244-2121
武蔵小杉 営業所	神奈川県川崎市中原区新丸子町915番地 (武蔵小杉フコク生命ビル2F)	(044)577-2530
藤沢支店	神奈川県藤沢市藤沢462番地	(0466)23-8111
鎌倉支店	神奈川県鎌倉市小町1丁目4番10号	(0467)23-1616
厚木支店	神奈川県厚木市中町4丁目14番1号	(046)224-8111
茅ヶ崎支店	神奈川県茅ヶ崎市新栄町9番9号	(0467)58-6111
横須賀支店	神奈川県横須賀市大滝町2丁目6番地	(046)821-1800

中部・北陸地区

新潟支店	新潟県新潟市中央区 本町通七番町1093番地の2	(025)223-4101
長岡支店	新潟県長岡市東坂之上町1丁目2番5号	(0258)37-9001
富山支店	富山県富山市荒町3番3号	(076)424-2411
高岡支店	富山県高岡市末広町1014	(0766)21-3500
金沢支店	石川県金沢市上堤町3番25号	(076)262-4211
福井支店	福井県福井市中央1丁目4番28号	(0776)22-3311
甲府支店	山梨県甲府市丸の内2丁目1番1号	(055)222-0121
長野支店	長野県長野市南石堂町1282番16号	(026)227-6501
上田営業所	長野県上田市天神1丁目9番3号 (ASANOBUILD3F)	(026)477-0115
松本支店	長野県松本市大手2丁目3番18号	(0263)35-0131
岐阜支店	岐阜県岐阜市高砂町1丁目17番 (岐阜イーストライジング24 2F)	(058)265-2171
静岡支店	静岡県静岡市葵区追手町1番1号	(054)254-3151
浜松支店	静岡県浜松市中区砂山町6番地1	(053)454-1411
沼津支店	静岡県沼津市大手町5丁目7番22号	(055)962-3590
名古屋支店	愛知県名古屋市中村区名駅1丁目1番1号 (JPタワー名古屋20F)	(052)563-3111
八事営業所	愛知県名古屋市中村区山手通5丁目7番地の1 (アイルモネ山手1F)	(052)728-1000
鳴海営業所	愛知県名古屋市中村区鳴海町向田1番地3 (名鉄鳴海駅構内2F)	(052)728-1020
藤が丘営業所	愛知県名古屋市中村区明が丘124番地の2 (ami ami annex1F)	(052)728-1030
桑名営業所	三重県桑名市寿町2丁目31番12号 (三交桑名駅前ビル3F)	(052)728-1040
多治見営業所	岐阜県多治見市本町3丁目101番1号 (クリスタルプラザ多治見3F)	(052)559-0320
豊橋支店	愛知県豊橋市駅前大通1丁目27番1号	(0532)55-0011
岡崎支店	愛知県岡崎市明大寺本町2丁目16番	(0564)24-6811
一宮支店	愛知県一宮市本町3丁目2番14号	(0586)71-6311
津支店	三重県津市丸之内32番18号	(059)226-7111

近畿地区

彦根支店	滋賀県彦根市佐和町6番9号	(0749)23-2111
京都支店	京都府京都市下京区御旅町39丁目1番 (シカタビル5F)	(075)251-2111
伏見営業所	京都府京都市伏見区 東大手町763番地(若由ビル3F)	(075)251-2160
大津営業所	滋賀県大津市浜大津2-1-36 (大津フコク生命ビル1F)	(075)757-6920
大阪支店	大阪府大阪市北区 曽根崎新地1丁目13番20号	(06)6454-7778
梅田支店	大阪府大阪市北区芝田1丁目1番3号 (阪急三番街南館2F)	(06)6373-3311
北千里営業所	大阪府吹田市古江台4丁目2番60号 (北千里医療ビル2F)	(06)6373-3130

店舗名	住所	電話番号
難波支店	大阪府大阪市中央区難波4丁目2番3号	(06)6632-5151
京橋支店	大阪府大阪市都島区東野田町2丁目3番14号	(06)6354-1201
香里園営業所	大阪府寝屋川市香里南之町30番14号 (第2香栄ビル1F)	(06)4967-4410
阿倍野支店	大阪府大阪市阿倍野区阿倍野筋1丁目1番43号 (あべのハルカス18F)	(06)6624-0333
岸和田支店	大阪府岸和田市五軒屋町3番8号	(072)423-3501
豊中支店	大阪府豊中市本町1丁目5番9号	(06)6854-1131
茨木支店	大阪府茨木市双葉町10番1号 (茨木東阪急ビル2F)	(072)632-0651
堺支店	大阪府堺市堺区南花田町2丁目3番1号	(072)223-8850
神戸支店	兵庫県神戸市中央区三宮町1丁目2番4号	(078)392-7911
芦屋営業所	兵庫県芦屋市船戸町3番2号(タムラビル4F)	(078)955-9710
姫路支店	兵庫県姫路市駅前町60 (マルイト姫路ビル1F)	(079)223-2881
尼崎支店	兵庫県尼崎市昭和南通4丁目27	(06)6411-1481
明石支店	兵庫県明石市本町2丁目2番22号	(078)917-0001
西宮支店	兵庫県西宮市高松町3番32号 (北口南阪急ビル2F)	(0798)66-3500
奈良支店	奈良県奈良市高天町48番地1	(0742)23-1271
和歌山支店	和歌山県和歌山市本町1丁目47番地	(073)431-1131

中国地区

鳥取支店	鳥取県鳥取市今町1丁目121番地	(0857)29-1511
松江支店	島根県松江市朝日町480番地8	(0852)27-7151
岡山支店	岡山県岡山市北区下石井1丁目1番3号 (日本生命ビル1F)	(086)225-1111
広島支店	広島県広島市中区基町12番9号	(082)228-5211
福山支店	広島県福山市延広町1番1号	(084)931-3333
下関支店	山口県下関市細江町1丁目2番12号	(083)231-5151
徳山支店	山口県周南市みなみ銀座1丁目1番地	(0834)21-5601
山口営業所	山口県山口市中央3丁目1番7号 (ミツイビル3F)	(0834)21-5670

四国地区

徳島支店	徳島県徳島市元町1丁目24番地	(088)623-0131
高松支店	香川県高松市番町1丁目1番1号	(087)822-2222
松山支店	愛媛県松山市三番町3丁目9番地10	(089)941-7101
新居浜支店	愛媛県新居浜市港町2番10号	(0897)33-5800
高知支店	高知県高知市本町1丁目2番7号	(088)823-0323

九州・沖縄地区

福岡支店	福岡県福岡市中央区天神1丁目12番5号	(092)713-4007
香椎営業所	福岡県福岡市東区香椎駅前2丁目11番15号 (香椎プリンスⅡ4F)	(092)577-9660
北九州支店	福岡県北九州市小倉北区 米町1丁目2番26号	(093)531-1141
久留米支店	福岡県久留米市東町35番地9	(0942)33-2131
佐賀支店	佐賀県佐賀市駅南本町4番1号	(0952)24-6121
長崎支店	長崎県長崎市万才町7番1号	(095)823-0181
熊本支店	熊本県熊本市中央区花畑町12番28号	(096)353-2551
大分支店	大分県大分市中央町1丁目4番26号	(097)537-8111
宮崎支店	宮崎県宮崎市橘通東4丁目6番30号	(0985)29-5211
鹿児島支店	鹿児島県鹿児島市金生町6番9号	(099)223-5141
那覇支店	沖縄県那覇市松山1丁目1番14号	(098)861-5200
コンタクト センター	東京都江東区東陽2丁目3番2号	(0120)010101
大和証券コンタクトセンターフリーダイヤル	0120-010101	
大和証券ホームページ	http://www.daiwa.jp/	

開示項目一覧【大和証券グループ本社】(2019年3月31日現在)

金融商品取引業等に関する内閣府令第208条の26

	(以下のページに掲載しています) 大和証券 グループ本社	(以下のページに掲載しています) 大和証券 グループ本社
最終指定親会社の概況及び組織に関する次に掲げる事項		
1. 商号又は名称	2	
2. 法第57条の12第1項の規定による指定を受けた日	2	
3. 沿革及び経営の組織(最終指定親会社の子法人等(法第57条の16の説明書類の内容に重要な影響を与えない子法人等を除く。以下この条において同じ。)の経営管理に係る体制を含む。)	2-3	
4. 株式等(株式又は持分をいう。)に係る議決権の保有数の上位10位までの株主又は出資者の氏名又は名称並びにその株式等に係る議決権の保有数及び総株主等の議決権に占める当該株式等に係る議決権の数の割合	5	
5. 法第57条の13第1項第2号から第4号までに掲げる事項及び第208条の19第1号に掲げる事項	2-5	
6. 対象特別金融商品取引業者の商号、登録年月日及び登録番号並びに届出日	2	
最終指定親会社及びその子法人等の概況に関する次に掲げる事項		
1. 最終指定親会社及びその子法人等の主要な事業の内容及び組織の構成	6	
2. 最終指定親会社の子法人等に関する次に掲げる事項		
①商号又は名称	6-11	
②本店又は主たる事務所の所在地	6-11	
③資本金の額、基金の総額又は出資の総額	6-11	
④事業の内容	6-11	
⑤最終指定親会社が保有する子法人等の議決権の数が、当該子法人等の総株主等の議決権の数に占める割合	6-11	
⑥最終指定親会社及びその一の子法人等以外の子法人等が保有する当該一の子法人等の議決権の数が、当該一の子法人等の総株主等の議決権の数に占める割合	6-11	
最終指定親会社及びその子法人等の業務の状況に関する次に掲げる事項		
1. 直近の事業年度における業務の概要	12-19	
2. 直近の三連結会計年度における業務の状況を示す指標として次に掲げる事項		
①営業収益(売上高その他これに準ずるものを含む。)	20	
②経常利益又は経常損失	20	
③親会社株主に帰属する当期純利益又は親会社株主に帰属する当期純損失	20	
④包括利益	20	
⑤純資産額	20	
⑥総資産額	20	
⑦各連結会計年度終了の日における連結自己資本規制比率(法第57条の17第1項に規定する自己資本の充実の状況が適当であるかどうかの基準に係る算式により得られる比率をいう。)	20	
最終指定親会社及びその子法人等の直近の二連結会計年度における財産の状況に関する事項として次に掲げるもの		
1. 連結貸借対照表(関連する注記を含む。)、連結損益計算書(関連する注記を含む。)及び連結包括利益計算書(関連する注記を含む。)若しくは連結損益及び包括利益計算書(関連する注記を含む。)並びに連結株主資本等変動計算書(関連する注記を含む。)又は指定国際会計基準により作成が求められるこれらの書類に相当するもの	21-38	
2. 各連結会計年度終了の日における次に掲げる事項		
①借入金の主要な借入先及び借入金額	38	
②保有する有価証券(トレーディング商品(連結貸借対照表の科目のトレーディング商品又はこれに準ずるものをいう。)に属するものとして経理された有価証券を除く)の取得価額、時価及び評価損益	38-39	
		③デリバティブ取引(トレーディング商品に属するものとして経理された取引を除く。)の契約価額、時価及び評価損益
		39
		3. 最終指定親会社及びその子会社等(令第15条の16の2第2項に規定する子会社等をいい、法第57条の16の説明書類の内容に重要な影響を与えないものを除く。)が2以上の異なる種類の事業を行っている場合の事業の種類ごとの区分に従い、当該区分に属する営業収益、経常利益又は経常損失及び資産の額として算出したもの(各営業収益等の額の営業収益等の総額に占める割合が少ない場合を除く。)
		16-17
		4. 金融商品取引業等に関する内閣府令4号イに掲げる書類について会社法第444条第4項の規定に基づき会計監査人の監査を受けている場合には、その旨
		40
		5. 経営の健全性の状況(法第57条の17第2項に規定する経営の健全性の状況をいい、連結自己資本規制比率に係るものを除く。)
		41-90
		報酬等(報酬、賞与その他の職務執行の対価として最終指定親会社若しくはその子法人等から受ける財産上の利益又は労働基準法第11条に規定する賃金をいう。)に関する事項であって、最終指定親会社及びその子法人等の業務の運営又は財産の状況に重要な影響を与えるものとして金融庁長官が定めるもの
		91-92

開示項目一覧【大和証券】(2019年3月31日現在)

金融商品取引業等に関する内閣府令第174条

	(以下のページに掲載しています)	(以下のページに掲載しています)
	大和証券	大和証券
金融商品取引業者の概況及び組織に関する次に掲げる事項		
1. 商号、登録年月日及び登録番号	94	
2. 沿革及び経営の組織	94-95	
3. 株式の保有数の上位10位までの株主の氏名又は名称並びにその株式の保有数及び総株主等の議決権に占める当該株式に係る議決権の数の割合	97	⑦株券の売買高(有価証券等清算取次ぎの委託高(有価証券等清算取次ぎの委託の取次ぎの取扱高を除く。)を含む。)及びその受託の取扱高(有価証券等清算取次ぎの受託高を除き、有価証券等清算取次ぎの委託の取次ぎの取扱高を含む。)
4. 法第29条の2第1項第3号から第9号までに掲げる事項		⑧国債証券、社債券、株券及び投資信託の受益証券の引受高、売出高及び募集、売出し、私募又は特定投資家向け売付け勧誘等の取扱高
①役員の氏名又は名称	96	⑨その他業務の状況(法第35条第2項各号に掲げる業務又は同条第4項の承認を受けた業務をいう。)
②政令で定める使用人の氏名		⑩各事業年度終了の日における自己資本規制比率
・金融商品取引業に関し、法令等(法令、法令に基づく行政官庁の処分又は定款その他の規則をいう。)を遵守させるための指導に関する業務を統括する者、その他これに準ずる者として内閣府令で定める者	96	⑪各事業年度終了の日における使用人の総数及び外務員の総数
・投資助言業務(法第28条第6項に規定する投資助言業務をいう。)又は投資運用業(同条第4項に規定する投資運用業をいう。)に関し、助言又は運用(その指図を含む。)を行う部門を統括する者、その他これに準ずる者として内閣府令で定める者	96	
・投資助言・代理業(法第28条第3項に規定する投資助言・代理業をいう。)に関し、法第29条の2第1項第6号の営業所又は事務所の業務を統括する者、その他これに準ずる者として内閣府令で定める者	96	
③業務の種別(法第28条第1項第1号、第2号、第3号イからハまで及び第4号に掲げる行為に係る業務並びに有価証券等管理業務、第二種金融商品取引業、投資助言・代理業並びに投資運用業の種別をいう。)	97	
④本店その他の営業所又は事務所の名称及び所在地	115-116	
⑤他に事業を行っているときは、その事業の種類	97	
⑥その他内閣府令で定める事項		
・法第37条の7第1項第1号イ、第2号イ、第3号イ又は第4号イに定める業務に係る手続実施基本契約を締結する措置を講ずる当該手続実施基本契約の相手方である指定紛争解決機関の商号又は名称並びに加入する金融商品取引業協会(認可金融商品取引業協会又は認定金融商品取引業協会をいう。)及び対象事業者(法第79条の11第1項に規定する対象事業者をいう。)となる認定投資者保護団体の名称	97	
・会員又は取引参加者となる金融商品取引所の名称又は商号	97	
・加入する投資者保護基金の名称	97	
・金融商品取引業等に関する内閣府令第7条第3号イ及び4号から9号に掲げる事項のうち当社が行う業務	97	
5. 法第37条の7第1項第1号ロ、第2号ロ、第3号ロ又は第4号ロに定める業務に関する苦情処理措置及び紛争解決措置の内容	97	
金融商品取引業者の業務の状況に関する次に掲げる事項		
1. 直近の事業年度における業務の概要	98	
2. 直近の三事業年度における業務の状況を示す指標として次に掲げる事項		
①営業収益及び純営業収益	99	
②経常利益又は経常損失	99	
③当期純利益又は当期純損失	99	
④資本金の額及び発行済株式の総数	99	
⑤受入手数料の内訳	99	
⑥トレーディング損益(損益計算書の科目のトレーディング損益をいう。)その他の自己取引に係る損益の内訳	99	
金融商品取引業者の直近の二事業年度における財産の状況に関する事項として次に掲げるもの		
1. 貸借対照表(関連する注記を含む。)、損益計算書(関連する注記を含む。)		101-113
2. 各事業年度終了の日における次に掲げる事項		
①借入金の主要な借入先及び借入金額		112
②保有する有価証券(トレーディング商品(貸借対照表の科目のトレーディング商品をいう。))に属するものとして経理された有価証券を除く。)の取得価額、時価及び評価損益		113
③デリバティブ取引(トレーディング商品に属するものとして経理された取引を除く。)の契約価額、時価及び評価損益		113
3. 金融商品取引業等に関する内閣府令第174条3号イに掲げる書類について会社法第436条第2項の規定に基づき会計監査人の監査を受けている場合には、その旨		113
金融商品取引業者の管理の状況に関する次に掲げる事項		
1. 内部管理の状況の概要		99
2. 法第43条の2から第43条の3の規定により管理される金銭又は有価証券の種類ごとの数量若しくは金額及び管理の状況		114
金融商品取引業者(法第57条の4の規定により当該事業年度に係る同条の説明書類を作成する特別金融商品取引業者を除く。)の連結財務諸表の用語、様式及び作成方法に関する規則第2条第3号に規定する子会社及び同条第7号に規定する関連会社の状況に関する次に掲げる事項		
1. 金融商品取引業者及びその子会社等の集団の構成		114
2. 子会社等の商号又は名称、本店又は主たる事務所の所在地、資本金の額、基金の総額又は出資の総額、事業の内容並びに金融商品取引業者及び他の子会社等が保有する議決権の数の合計及び当該子会社等の総株主等の議決権に占める当該保有する議決権の数の割合		114