

業務及び財産の状況に関する説明書類 【2021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

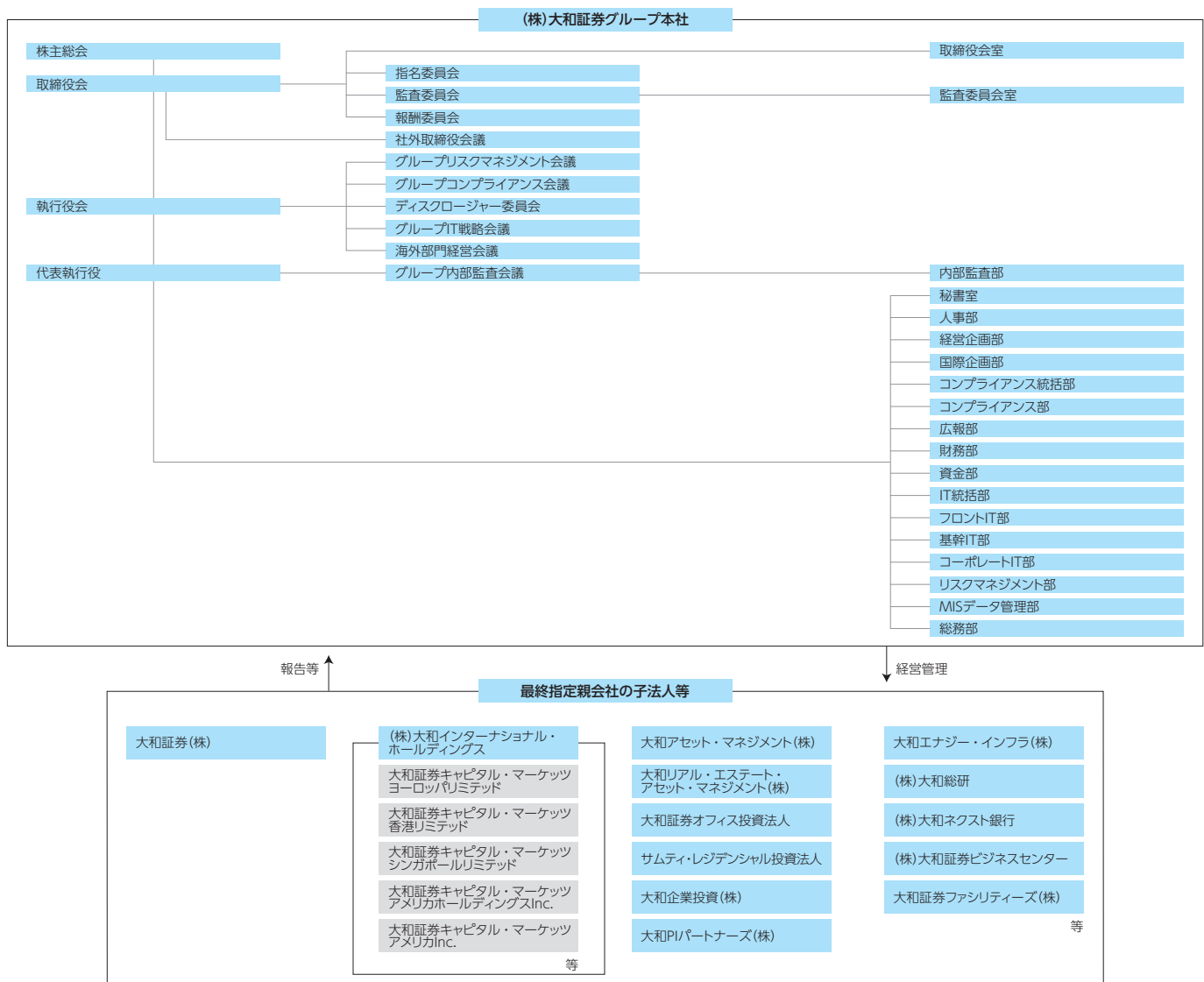
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

沿革(2021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「大和証券エスビーキャピタル・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	「大和証券エスビーキャピタル・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。
2009年 7月	「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。「(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。
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・マーケットヨーロッパリミテッド」、「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.」、「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.」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。
2012年 4月	「大和証券(株)」が「大和証券キャピタル・マーケット(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。

年 月	概 要
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)](現「au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	[大和エネルギー・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。
2019年 4月	[(株)CONNECT]を設立。
9月	[サムティ・レジデンシャル投資法人]に追加出資し、子会社化。
2020年10月	大和プロパティ(株)及び大和オフィスサービス(株)が、全事業を[大和証券ファシリティーズ(株)]に承継し、大和証券(株)が両社を吸収合併。
2021年 3月	[大和証券オフィス投資法人]の自己投資口取得により、子会社化。

組織図 (2021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118社、持分法適用関連会社17社(2021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います。

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います。

役員一覽

(2021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
田代 桂子

取締役
荻野 明彦

取締役
花岡 幸子

取締役
川島 博政

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

社外取締役
岩本 敏男

社外取締役
村上 由美子

三委員会

指名委員会
小笠原 倫明(委員長)

日比野 隆司

中田 誠司

竹内 弘高

河合 江理子

西川 克行

岩本 敏男

監査委員会
西川 郁生(委員長)

花岡 幸子

川島 博政

小笠原 倫明

河合 江理子

西川 克行

村上 由美子

報酬委員会
竹内 弘高(委員長)

日比野 隆司

中田 誠司

西川 郁生

岩本 敏男

村上 由美子

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
田代 桂子

執行役副社長
高橋 一夫

執行役副社長
小松 幹太

執行役副社長
松下 浩一

執行役副社長
中川 雅久

専務執行役
荻野 明彦

専務執行役
新妻 信介

専務執行役
望月 篤

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

常務執行役(CIO)
村瀬 智之

常務執行役(CFO)
佐藤 英二

執行役
日比野 隆司

執行役員

専務執行役員
岡 裕則

常務執行役員
荒木 秀輝

常務執行役員
柳沢 志向

常務執行役員
山内 章

常務執行役員
代田 英展

常務執行役員
小林 奨

執行役員
竹内 由紀子

執行役員
鈴木 直樹

執行役員
田中 稔介

執行役員
山田 孝志

執行役員
板屋 篤

執行役員
早川 由紀

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

(2021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）	129,328千株	8.49%
株式会社日本カストディ銀行（信託口）	61,931千株	4.06%
太陽生命保険株式会社	41,140千株	2.69%
パークレイズ証券株式会社	34,390千株	2.25%
日本生命保険相互会社	31,164千株	2.04%
NORTHERN TRUST CO. (AVFC) RE SILCHESTER INTERNATIONAL INVESTORS INTERNATIONAL VALUE EQUITY TRUST	30,973千株	2.03%
日本郵政株式会社	30,000千株	1.96%
大和持株会	23,389千株	1.53%
株式会社日本カストディ銀行（信託口5）	22,649千株	1.48%
STATE STREET BANK WEST CLIENT - TREATY 505234	22,299千株	1.46%

(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(175,501,735株)を控除して計算しております。
 (注4) 当社は、2021年3月31日現在、自己株式175,501千株を保有していますが、上記大株主から除外しています。

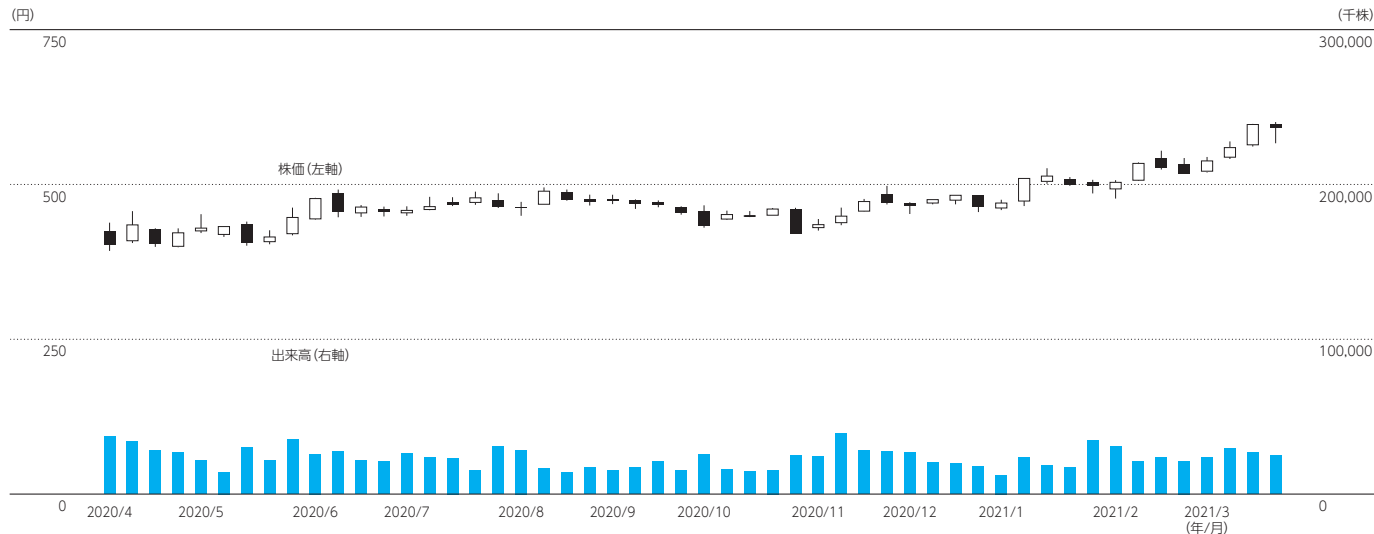
資本金の額 247,397百万円 (2021年3月31日現在)

株価情報

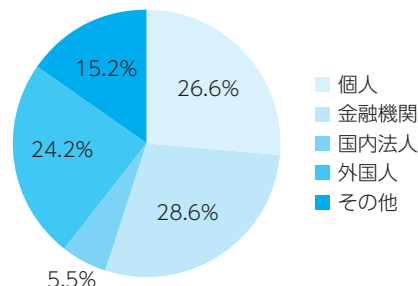
東京証券取引所における当社株価 (2020年4月1日～2021年3月31日)

始 値	高 値	安 値	終 値	一日平均出来高
425.0円	600.8円	392.7円	591.6円	5,048千株

株価・出来高の推移 (2020年4月1日～2021年3月31日)



所有者別株式分布状況 (2021年3月31日現在)



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 (2021年3月31日現在)

●=連結子会社、■持分法適用関連会社

最終指定親会社	子法人等	主要な事業の内容
株式会社大和証券グループ本社	リテール部門 ●大和証券株式会社 他	有価証券関連業、投資助言・代理業
	ホールセール部門 (注1) ●大和証券株式会社 ●大和証券キャピタル・マーケットツヨーロッパリミテッド ●大和証券キャピタル・マーケットツ香港リミテッド ●大和証券キャピタル・マーケットツシンガポールリミテッド ●大和証券キャピタル・マーケットツアメリカホールディングスInc. ●大和証券キャピタル・マーケットツアメリカInc. 他	有価証券関連業、投資助言・代理業 有価証券関連業 有価証券関連業 有価証券関連業 子会社の統合・管理 有価証券関連業
	アセット・マネジメント部門 ●大和アセットマネジメント株式会社 ●大和リアル・エステート・アセット・マネジメント株式会社 ●大和証券オフィス投資法人 ●サムティ・レジデンシャル投資法人 他	投資運用業、投資助言・代理業 投資運用業、投資助言・代理業 投資運用業 投資運用業
	投資部門 ●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 他	投資業 投資業 投資業
	その他 ●株式会社大和総研ホールディングス(注2) ●株式会社大和総研(注2) ●株式会社大和総研ビジネス・イノベーション(注2) ●株式会社大和ネクスト銀行 ●株式会社大和証券ビジネスセンター ●大和証券ファシリティーズ株式会社 他	子会社の統合・管理 情報サービス業 情報サービス業 銀行業 事務代行業 不動産賃貸業

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

(注2) 株式会社大和総研ホールディングス、株式会社大和総研及び株式会社大和総研ビジネス・イノベーションの3社は、2021年4月1日付で株式会社大和総研ホールディングスを吸収合併存続会社、株式会社大和総研及び株式会社大和総研ビジネス・イノベーションを吸収合併消滅会社とする吸収合併を行い、商号を株式会社大和総研といたしました。

最終指定親会社の子法人等に関する事項

(2021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
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
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	持株会社	0	100
大和企業投資株式会社	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	子会社の統合・管理	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・インベストメント株式会社	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	投資運用業、投資助言・代理業、 有価証券等に関する調査研究、コンサルティング	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
大和インバスター・リレーションズ株式会社	東京都中央区	—	—	—	—
リテラ・クレア証券株式会社	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	78.2	83.9

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
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号住友不動産六本木グランドタワー33階	2,016百万円	子会社の統合、管理	18.5	18.6
アストマックス株式会社	東京都品川区	—	—	—	—
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	特定資産に対する投資運用	12.1	38.3
のぞみ債権回収株式会社	東京都中央区	—	—	—	—
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	—	—	—	—
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	17.4	17.4
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	子会社の統合、管理	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
Daiwa Corporate 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
Daiwa Corporate 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	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	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	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	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	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	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	0	90
DBP-Daiwa Capital Markets Philippines, Inc.	Citibank Tower, 8741 Paseo de Roxas, Salcedo Village, Makati City, Republic of the Philippines	255百万 ペソ	有価証券関連業	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	0	100
Daiwa Securities Capital Markets Korea Co., Ltd.	One IFC, 10 Gukjeumyung-Ro, Yeongdeungpo-Gu, Seoul 07326, Korea	21,680百万 ウォン	有価証券関連業	0	100
Daiwa Asset Management (America) Ltd.	New York, NY 10005-3538, U.S.A.	—	—	—	—
Daiwa Asset Management (Europe) Ltd	London, EC4N 7AX, United Kingdom	—	—	—	—
Daiwa Asset Management (H.K.) Limited	Hong Kong	—	—	—	—
Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore 048693	—	—	—	—
Daiwa Asset Management Services Ltd. (Cayman)	Grand Cayman, KY1-1104, Cayman Islands	—	—	—	—
Daiwa Portfolio Advisory (India) Private Limited	Mumbai , 400 051, India	—	—	—	—
大和日華(上海)企業諮詢有限公司	Shanghai China 200120	—	—	—	—
Myanmar Securities Exchange Centre Co., Ltd	Yangon, Union of Myanmar	—	—	—	—
DIR-ACE Technology Ltd.	Yangon, Myanmar	—	—	—	—
Daiwa Corporate Investment Asia Ltd.	Hong Kong	—	—	—	—
DS Capital International (NI) Ltd.	Grand Cayman, KY1-1104, Cayman Islands	—	—	—	—
湖北高和創業投資管理有限公司	湖北省武漢市	—	—	—	—
Daiwa Capital Markets Investments Asia Limited	One Pacific Place, 88 Queensway, Hong Kong	370百万 米ドル	資産管理業務	0	100
Daiwa Capital Markets Investments Hong Kong Limited	One Pacific Place, 88 Queensway, Hong Kong	15百万 米ドル	資産管理業務	0	100
DIR XunHe Business Innovation (Hong Kong) Limited (訊和創新有限公司)	Hong Kong	—	—	—	—
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	—	—	—	—
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	—	—	—	—
DCIハイテ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	—	—	—	—
有限会社ブルーデージー	東京都中央区	—	—	—	—
有限会社ローズマリー	東京都港区	—	—	—	—
有限会社ワイ・エス・アール・ツー	東京都中央区	—	—	—	—
有限会社エヌ・エル・シー	東京都中央区	—	—	—	—
有限会社ディー・エス・エムインベストメンツラムダ	東京都千代田区	—	—	—	—
合同会社カンプリア	東京都中央区	—	—	—	—
株式会社日本海企業支援ファンド	東京都中央区	—	—	—	—

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(%)
大和チャレンジファンド株式会社	東京都中央区	—	—	—	—
合同会社DKエナジー	東京都港区	—	—	—	—
株式会社ブルーエルフィン	東京都中央区	—	—	—	—
株式会社十八チャレンジファンド	東京都中央区	—	—	—	—
株式会社ホームドクターファンド	東京都中央区	—	—	—	—
合同会社ブルースター	東京都中央区	—	—	—	—
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.	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	—	—	—	—
DMS Ltd.	Yangon, Myanmar	—	—	—	—
Yangon Stock Exchange Joint-Venture Company Limited	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	—	—	—	—
DCI Vietnam Capital Management Co. Ltd.	Grand Cayman, KY1-1104, Cayman Islands	—	—	—	—
DAIWA-SSIAM Vietnam Growth Fund II L.P.	Grand Cayman, KY1-1104, Cayman Islands	—	—	—	—
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	—	—	—	—
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	—	—	—	—
グリーン・サマル株式会社	東京都港区	—	—	—	—
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	—	—	—	—
株式会社IDIインフラストラクチャーズ	東京都港区	100百万円	投資運用業	50	50
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	100百万円	投資運用業	23.04	27.37
SKM合同会社	東京都千代田区	—	—	—	—
HOM合同会社	東京都千代田区	—	—	—	—
SSI Securities Corporation	Hochiminh City, Vietnam	11,701百万円	有価証券関連業務	20.03 20.07	20.03 20.07
株式会社DG Daiwa Ventures	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	5,000万円	投資運用業	50	50
日光太陽光発電合同会社	東京都千代田区	—	—	—	—
合同会社ネモフィラ	東京都中央区	—	—	—	—
合同会社キャッツテール	東京都中央区	—	—	—	—
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	33.4	33.4
バイオマス・フューエル株式会社	東京都中央区	—	—	—	—
多気太陽光発電合同会社	東京都千代田区	—	—	—	—
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	100百万円	持株会社	0	100
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	100百万円	貸金業務及びコンサルティング業務	0	100
Daiwa Corporate Advisory India PVT. LTD.	Karnataka, India	—	—	—	—
合同会社DRロジスティクス2	東京都中央区	—	—	—	—
Daiwa Capital Markets Deutschland GmbH	Neue Mainzer Straße 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	—	—	—	—
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	—	—	—	—
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	54,483百万円	投資運用業務	38.3	40.2
au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
湖北通瀛株権投資基金合伙企业(有限合伙)	湖北省武漢市	—	—	—	—
Fintertech株式会社	東京都千代田区一番町5番地	400百万円	新規事業の創出、貸金業	66	66
BF Cayman	Cayman Islands	—	—	—	—
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	—	—	—	—

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(%)
Asian Energy Investments Pte., Ltd.	Singapore 0499909	—	—	—	—
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	—	—	—	—
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	投資運用業	0	100
ダイワGIグリーンファンド合同会社	東京都港区	—	—	—	—
合同会社博多ホテルマネジメント	東京都中央区	—	—	—	—
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	—	—	—	—
Roots Capital Investment Pte.Ltd.	Singapore 079903	—	—	—	—
ACA Investments Pte Ltd	Singapore (038988)	—	—	—	—
大和ACAヘルスケア株式会社	東京都千代田区永田町一丁目11番30	—	—	—	—
大和グロースキャピタル投資事業 有限責任組合	東京都港区	—	—	—	—
大和ACA事業承継投資事業有限責任組合	東京都千代田区	—	—	—	—
大和フード&アグリ株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	100百万円	農業に関するビジネスの企画運 営、投融資	100	100
株式会社丸の内リアルティ	東京都中央区	—	—	—	—
イークラウド株式会社	東京都中央区	—	—	—	—
Daiwa Corporate Advisory SLU	Spain	—	—	—	—
大和ACA・HCブリッジ投資事業有限責 任組合	東京都千代田区	—	—	—	—
DEIソーラーファンドアルファ合同会社	東京都千代田区	—	—	—	—
富山水橋太陽光発電合同会社	東京都千代田区	—	—	—	—
合同会社東京ホテルマネジメント4	東京都港区	—	—	—	—
投資事業組合「DPIP企業支援1号」	東京都千代田区	—	—	—	—
Innovation Growth Ventures株式会社	東京都千代田区	—	—	—	—
株式会社CONNECT	東京都中央区京橋一丁目2番1号	900百万円	有価証券関連業	100	100
合同会社HPS-AP	東京都中央区	—	—	—	—
三井住友DSアセットマネジメント株式会社	東京都港区愛宕二丁目5番1号	2,000百万円	投資運用業	23.5	23.5
株式会社さつまゴルフリゾート	鹿児島県薩摩郡	—	—	—	—
DAIWA Myanmar Growth Fund L.P.	Grand Cayman, KY1-1104, Cayman Islands	—	—	—	—
合同会社DRロジスティクス5	東京都中央区	—	—	—	—
合同会社はこだて恵山地熱	東京都中央区	—	—	—	—
合同会社DSB-3	東京都中央区	—	—	—	—
サムティ株式会社	大阪市淀川区西中島四丁目3番24号 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号	16,184百万円	不動産賃貸業・管理業	16.9	20
合同会社東京ホテルマネジメント5	東京都港区	—	—	—	—
Daiwa ACA APAC Growth LP	Grand Cayman, KY1-1104, Cayman Islands	—	—	—	—
Swimsol GmbH	Vienna, Austria	—	—	—	—
合同会社京都堀川ホテルマネジメント を営業者とする匿名組合出資事業	東京都中央区	—	—	—	—
アフターフィット大和白老町竹浦ソー ラー合同会社	東京都千代田区	—	—	—	—
大和ACAヘルスケア・ファイナンス株 式会社	東京都千代田区	—	—	—	—
KDM Power Limited	London, England	—	—	—	—
グッドタイムリビング株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	50百万円	有料老人ホーム、高齢者向け賃貸 住宅等の運営	100	100
合同会社GTLヘルスケア	東京都中央区	—	—	—	—
Global X Japan株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	5,000百万円	投資運用業 投資助言・代理業	10	50
合同会社東京ホテルマネジメント6	東京都港区	—	—	—	—
株式会社おひさまホールディングス	東京都足立区	—	—	—	—
DC Advisory Holdings Limited	United Kingdom	—	—	—	—
Daiwa Sustainable Investments Limited	United Kingdom	—	—	—	—
Daiwa Corporate Advisory S.r.l.	MILANO	—	—	—	—

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(%)
Green Giraffe Advisory B.V.	Netherlands	—	—	—	—
Green Tower B.V.	Netherlands	—	—	—	—
DEIランドホールディングス合同会社	東京都千代田区	—	—	—	—
合同会社東京レジデンシャル1	東京都中央区	—	—	—	—
大和証券ファシリティーズ株式会社	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・管理業	100	100
福島富岡ソーラーキャッスル合同会社	東京都千代田区	—	—	—	—
合同会社ホテルプロジェクト高山を営業者とする匿名組合出資事業	東京都港区	—	—	—	—
株式会社刀	東京都港区港南二丁目16番2号28階	3,753百万円	テーマパークその他エンタテインメント施設、流通、小売り等の企画及び運営、並びに投資	38.5	38.5
FUM Thirteenth株式会社	東京都千代田区	—	—	—	—
合同会社GTLヘルスケア2	東京都中央区	—	—	—	—
株式会社平洲農園	山形県東置賜郡	—	—	—	—
アフターフィット大和那珂太陽光合同会社	東京都千代田区	—	—	—	—
Daiwa Capital Management Silicon Valley Inc.	California 94301, United States of America	—	—	—	—
Iホールディングス株式会社	東京都千代田区	—	—	—	—
合同会社DAヘルスケア4	東京都港区	—	—	—	—
株式会社IP Bridge	東京都千代田区	—	—	—	—
合同会社IP Bridge1号	東京都千代田区	—	—	—	—
株式会社みらいの畑から	大分県玖珠郡	—	—	—	—
合同会社ロッキークートワンを営業者とする匿名組合出資事業	東京都中央区	—	—	—	—
合同会社ロッキークートツーを営業者とする匿名組合出資事業	東京都中央区	—	—	—	—
合同会社ロッキークートスリーを営業者とする匿名組合出資事業	東京都中央区	—	—	—	—
合同会社ロッキークートフォーを営業者とする匿名組合出資事業	東京都中央区	—	—	—	—
合同会社ロッキークートファイブを営業者とする匿名組合出資事業	東京都中央区	—	—	—	—
合同会社ロッキークートシックスを営業者とする匿名組合出資事業	東京都中央区	—	—	—	—
合同会社ロッキークートセブンを営業者とする匿名組合出資事業	東京都中央区	—	—	—	—
合同会社ロッキークートエイトを営業者とする匿名組合出資事業	東京都中央区	—	—	—	—
合同会社ロッキークートナインを営業者とする匿名組合出資事業	東京都中央区	—	—	—	—
合同会社ロッキークートテンを営業者とする匿名組合出資事業	東京都中央区	—	—	—	—
大和証券リビング投資法人	東京都中央区銀座六丁目2番1号	117,715百万円	不動産投資法人	15.7	16.4
南桜プロパティーズ特定目的会社	東京都港区	—	—	—	—
Aquila Capital Holding GmbH	Hamburg, Germany	—	—	—	—
合同会社DEI Green Investments Alpha	東京都千代田区	—	—	—	—
国新国和(杭州)企業管理諮詢有限公司	中国浙江省杭州市濱江区	—	—	—	—
栗原太陽光発電合同会社	東京都港区	—	—	—	—
RenoDa/パートナーズ合同会社	東京都千代田区	—	—	—	—
DCI Vietnam Fund III Management Co., Ltd.	Grand Cayman, KY1-1104, Cayman Islands	—	—	—	—
DAIWA-SSIAM Vietnam Growth Fund III L.P.	Grand Cayman, KY1-1104, Cayman Islands	—	—	—	—
中節能翼和(湖北)私募基金管理有限公司	中国湖北省	—	—	—	—
合同会社DSB-4	東京都中央区	—	—	—	—
島根奥出雲ソーラーたたら合同会社を営業者とする匿名組合出資事業	東京都千代田区	—	—	—	—
大和日台バイオベンチャー2号投資事業有限責任組合	東京都千代田区	—	—	—	—

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(中国)有限責任公司	北京市西城区	—	—	—	—
合同会社東京レジデンシャル3	東京都中央区	—	—	—	—
株式会社ライフ・クリエイト・パートナーズ	兵庫県神戸市	—	—	—	—
合同会社東京レジデンシャル2	東京都中央区	—	—	—	—
DC Advisory (Thailand) Co., Ltd	Bangkok 10330 Thailand	—	—	—	—
合同会社大和インターナショナル・イン ベストメンツ	東京都千代田区	—	—	—	—

※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。

経営成績および財政状態についての経営陣による分析

2020年度のマクロ経済環境

〈海外の状況〉

世界経済は、新型コロナウイルスの感染拡大を主な要因として、2020年前半に急激に悪化しましたが、2020年後半以降は総じて持ち直しの動きが見られています。IMF(国際通貨基金)が2021年4月に公表した世界経済見通しによれば、2020年は先進国、新興国ともにマイナス成長に転じ、世界経済成長率は $\Delta 3.3\%$ とリーマン・ショック時を上回る大幅なマイナス成長となる一方、2021年は前年の落ち込みからの反動もあり $+6.0\%$ と高い成長が見込まれています。もっとも、最悪期を脱した2020年後半以降も、世界経済は新型コロナウイルスの感染状況によって左右される状況が続いており、引き続き非常に不安定な状態が続いています。

米国経済は、新型コロナウイルスの感染者数の急増を受けて2020年前半に急速に悪化しましたが、その後は持ち直しの動きが続いています。2020年3月半ばに当時のトランプ大統領が緊急事態を宣言し、小売店や飲食店、娯楽施設などの営業規制や外出制限を実施したことによって、外食や娯楽関連など不要不急のサービスを中心に個人消費が急減しました。これにより、2020年1-3月期の実質GDP成長率は前期比年率 $\Delta 5.0\%$ と6年ぶりのマイナス成長となり、続く4-6月期の実質GDP成長率は同 $\Delta 31.4\%$ と、1947年の現行統計開始以来最大のマイナス幅を記録しました。しかし、営業規制・外出制限の段階的な解除に伴い経済活動が再開されたことに加え、政府による経済対策が下支えとなり、7-9月期の実質GDP成長率は前期比年率 $+33.4\%$ と大幅なプラスに転じました。10-12月期に入ると新型コロナウイルスの新規感染者数が大幅に増加する中、一部の州・地域で営業規制・外出制限が再び導入され、実質GDP成長率は前期比年率 $+4.3\%$ と、経済の回復ペースは大幅に鈍化しました。しかし、2021年に入って新型コロナウイルスワクチンの接種が順調に進む中、政府による行動規制の緩和が進んだことに加え、2020年12月、および2021年3月に成立した追加経済対策の効果もあり、2021年1-3月期の実質GDP成長率は前期比年率 $+6.4\%$ と再加速しました。

金融面では、FRB(連邦準備制度理事会)が積極的な金融緩和を行いました。新型コロナウイルス感染症の影響によって経済が急激に悪化したことを受け、FRBは2020年3月に2度の緊急利下げを実施し、2015年12月以来となる実質的なゼロ金利政策を復活させました。また、量的緩和の拡大も決定し、FRBのバランスシートは大幅に拡大しています。12月のFOMCでは、経済が十分に回復するまでFRBのバランスシートの拡大を続けることが約束されたことに加え、2021年3月時点では少なくとも2023年末まで政策金利がゼロで据え置かれる見通しが示され、緩和的な金融環境を長期にわたって維持する方針が引き続き示されています。

欧州経済(ユーロ圏経済)は、新型コロナウイルス感染症の影響が長引く中、厳しい状況が続いています。ユーロ圏でも多くの国が2020年3月半ばからロックダウンに踏み切ったことにより、個人消費や生産など、幅広い分野で経済が大きく落ち込み、1-3月

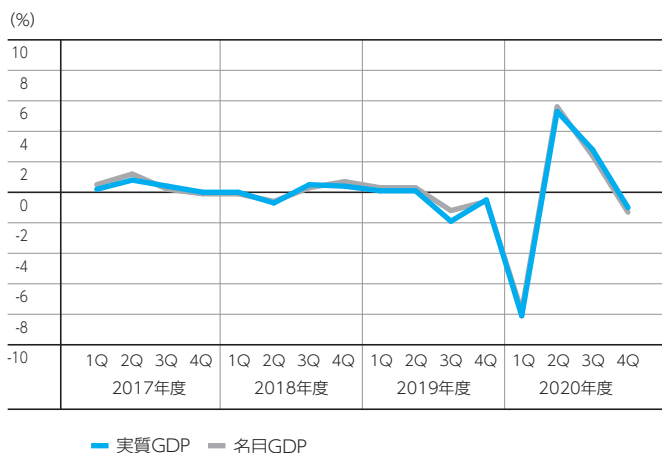
の実質GDP成長率は前期比年率 $\Delta 14.2\%$ と大幅なマイナスとなりました。また、4-6月期には同 $\Delta 38.8\%$ とさらにマイナス幅が拡大し、2四半期連続で統計開始以降の最悪値を更新しました。その後、早い国では4月半ばから、遅い国でも5月以降はロックダウンを緩和したことで、5月以降、ユーロ圏経済は持ち直しの動きに転じ、7-9月期の実質GDP成長率は前期比年率 $+60.3\%$ とプラスに転じました。しかし、新型コロナウイルスの感染者数が再び増加に転じたことを受け、ドイツ、フランスなど、多くの国で再びロックダウンを余儀なくされ、10-12月期の実質GDP成長率は前期比年率 $\Delta 2.7\%$ 、続く2021年1-3月期も同 $\Delta 2.5\%$ と2四半期連続のマイナス成長となり、一時的に持ち直していた欧州経済は再び悪化しました。

金融面では、ECB(欧州中央銀行)による金融緩和が続いています。新型コロナウイルスの感染拡大による急激な景気悪化を受けて、ECBは2020年3月の緊急会合で、新型コロナウイルス感染症対応のための新規の資産買い取りプログラムを設定し、量的緩和策の拡大を決定しました。その後、6月、12月には資産の買い取り枠が拡大されたほか、当初は2020年末までとされていた買い入れ期間も、12月に「少なくとも2022年3月まで」延長されるなど、金融緩和策が強化されました。新興市場国・発展途上国経済は、先進国と同様に2020年前半に急激に悪化した後、2020年後半以降持ち直しの動きが続いています。IMFによれば、新興国の実質GDP成長率は2020年に $\Delta 2.2\%$ とマイナス成長に陥った後、2021年は $+6.7\%$ と高い成長が見込まれています。

新興国のうち、世界第2位の経済規模を持つ中国では、2020年1-3月期には新型コロナウイルス感染症によって経済活動の停止を余儀なくされ、実質GDP成長率は前年同期比 $\Delta 6.8\%$ と、1992年に四半期ベースの統計が開始されて以降、初めてのマイナス成長となりました。しかし、他国に先んじて新型コロナウイルスの感染が収束へ向かったこともあり、4-6月期以降は着実に経済が持ち直しています。4-6月期の実質GDP成長率は前年同期比 $+3.2\%$ と、新型コロナウイルスの感染拡大以前に比べると成長率は小幅ながらプラス成長へと転じ、政策による下支えを背景とした投資の回復を主な要因として、7-9月期の実質GDP成長率は前年同期比 $+4.9\%$ とプラス幅が拡大しました。また、10-12月期以降も、世界の多くの地域で感染再拡大によって経済活動が制限されたのとは対照的に、中国国内での感染拡大は抑制された状況が続く、10-12月期の実質GDP成長率は前年同期比 $+6.5\%$ 、2021年1-3月期は同 $+18.3\%$ と成長ペースが加速しました。

中国以外の新興国についても、2020年後半以降持ち直しの動きが続いています。2020年前半は、新興国でも新型コロナウイルスの感染拡大を防止するために経済活動を制限せざるを得ない状況になったことに加えて、世界的な景気悪化を受けた資金流出や、資源価格の低迷などが、新興国経済を下押しする要因となりました。一方、2020年後半からは、米国や中国を中心とした海外経済の回復や、世界的な金融緩和を背景とした資金流入が新興国経済を下支えしています。ただし、新興国ではワクチン接種の実施が遅れている国が多く、感染再拡大による経済の下振れリスクが高い状況が続いています。

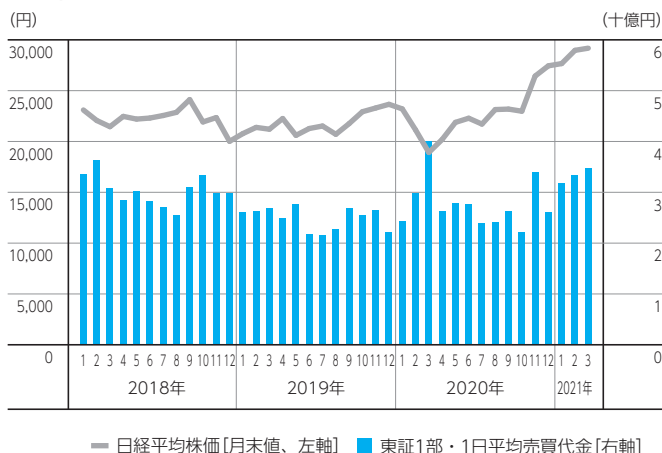
GDP成長率



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



出所：東京証券取引所、大和総研

〈日本の状況〉

日本経済は、2020年初めから新型コロナウイルス感染症の影響によって大幅に悪化した後、2020年後半に一時持ち直しに転じたものの、感染再拡大によって2021年に入り再び回復が足踏みしています。

日本の実質GDP成長率は、消費増税に伴う反動減があった2019年10－12月期から3四半期連続でマイナス成長となり、特に新型コロナウイルス感染症の影響が本格的に顕在化した2020年4－6月期は前期比年率△28.6%と、戦後最大のマイナス幅を記録しました。その後、緊急事態宣言が全面解除された5月下旬以降、社会経済活動が徐々に再開されたことで日本経済は持ち直しに転じ、7－9月期の実質GDPは前期比年率+22.9%と大幅な回復を見せました。また、10－12月期も政策による下支えなどを背景に、前期比+11.7%と持ち直しが続きました。しかし、感染再拡大に伴う緊急事態宣言の再発出による個人消費の低迷を主因に、2021年1－3月期は前期比年率△3.9%と再びマイナス成長に転じ、実質GDPは新型コロナウイルスの感染拡大前を下回る水準での推移が続いています。2020年度の実質GDP成長率は前年比△4.6%と、2年連続のマイナス成長となりました。

需要項目ごとに見ると、個人消費は低い水準での推移が続いています。2020年1－3月期は、2019年10月に実施された消費増税による落ち込みからの持ち直しが期待されていましたが、新型コロナウイルスの感染拡大による自粛の動きによって、外食などをはじめとする不要不急のサービス消費を中心に減少しました。さらに、個人消費を手控える動きは2020年4月7日の緊急事態宣言によって加速し、個人消費は大幅に減少することとなりました。その後、5月下旬に緊急事態宣言が全面解除されたことに加えて、特定定額給付金などの経済対策による下支えなどから、個人消費は持ち直しへと向かいました。しかし、感染拡大への懸念が強い状況が続く中、対面や移動を伴う接触型サービスの回復は緩やかなものとなり、緊急事態宣言の再発出により2021年に入って再び個人消費は悪化することとなりました。住宅投資については、消費増税に伴う反動減があった2019年10－12月期から2020年7－9月期にかけて減少し、その後は横ばい圏で推移しました。コロナ禍に伴う販売の低迷や建設の遅れに加えて、雇用環境の悪化や先行きに対する不透明感が、住宅投資の下押し要因となりました。

企業部門の需要である設備投資についても、新型コロナウイルス感染症の影響による収益環境の急速な悪化を受けて、2020年4－6月期から7－9月期にかけて減少傾向となりました。経済活動の再開が進む中で収益の悪化に歯止めがかかったことや、輸出の持ち直しを受けて2020年10－12月期は一時持ち直しの動きも見られましたが、緊急事態宣言の再発出によって2021年1－3月期には再び減少に転じました。日銀短観(2021年3月調査)によれば、2021年度の設備投資計画(含む土地投資額)は、前年比+0.5%の増加が見込まれています。もっとも、新型コロナウイ

ルスの影響を強く受けた業種などでは、引き続き設備投資に対して慎重であり、全体の回復ペースは緩やかなものとどまっています。

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ています。日本銀行は、新型コロナウイルスの感染拡大による急激な景気の悪化を受けて、2020年4月に、国債の購入額の上限を撤廃したほか、社債などの買い入れ枠を拡大するなど、量的緩和を強化しました。日本銀行による追加緩和策を受けて、日本の10年国債利回りは2020年4月に一時△0.04%台まで低下しました。世界的に経済活動再開の動きが広まる中で、5月末にはプラス圏を回復しつつも、2020年末頃までゼロ%近傍と非常に低い水準で安定的に推移しました。しかし、2021年に入って、景気過熱や財政悪化への懸念から米国の長期金利が上昇したのに伴い日本の長期金利も小幅ながら上昇し、2月末には一時、2018年10月以来初めて0.15%を上回りました。

為替市場を見ると、対ドルでは2020年4月から2020年末にかけては、総じて円高傾向で推移しました。世界的に経済活動再開への期待が高まった6月前半には、リスク回避の動きが弱まり、一時109円台まで円安が進みましたが、6月後半以降は、米国で新型コロナウイルスの感染が再拡大し、FRBによる追加金融緩和への期待感が強まったことなどから円高傾向に転じ、11月には2020年3月以来の103円台まで円高が進みました。しかし、2021年に入ると、経済対策による米国経済回復への期待感の高まりや米国での金利上昇を受け、それまでの円高傾向から一転して、3月末にかけて円安が進行しました。対ユーロについては、世界経済が急激に悪化し、リスク回避の動きが強まった4月から5月前半までは、対ドルと同様に円高傾向で推移しました。しかし、5月後半には欧州の景気回復期待から円安傾向へと転じ、さらにEU27カ国による復興基金案の合意を受けて、7月以降は円安が進行しました。欧州での新型コロナウイルスの感染再拡大などを懸念して、一時円高が進む局面もありましたが、ワクチン普及に伴う行動制限の緩和による欧州経済の回復期待から、年度末にかけて一層の円安が進みました。

株式市場は、2020年度に入って以降、総じて上昇基調で推移しました。新型コロナウイルスの感染拡大を受けて世界的に金融緩和が強化されたことによる低金利や、量的緩和拡大による需給の改善が株価を押し上げる要因となりました。また、2020年後半以降は、ワクチンの世界的な普及や、経済対策を背景とした米国経済の力強い回復への期待感が株価の押し上げ要因となり、2021年2月、日経平均株価は一時、1990年8月以来となる30,000円台まで上昇しました。

2021年3月末の日経平均株価は29,178円80銭(前年3月末比10,261円79銭高)、10年国債利回りは0.104%(同0.073ポイントの上昇)、為替は1ドル110円74銭(同2円32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14.3%減の5,761億円、純営業収益は同9.5%増の4,666億円となりました。

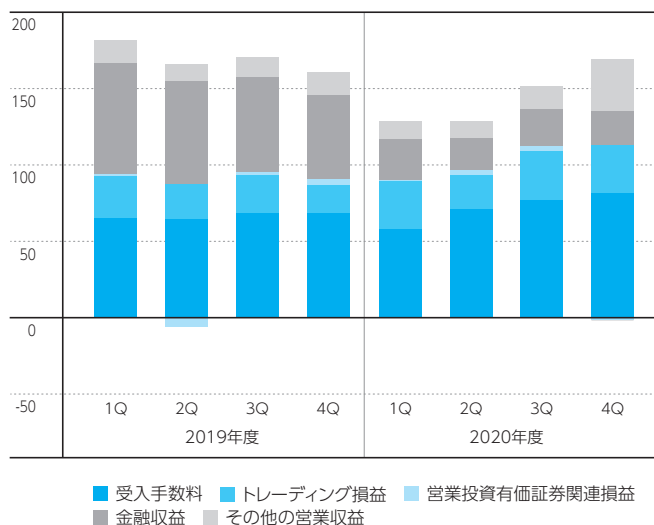
受入手数料は2,868億円と、同7.6%の増収となりました。委託手数料は、株式取引が増加したことにより、同38.1%増の780億円となりました。引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料は、複数の大型エクイティ引受案件等が貢献し増収となり、同27.8%増の380億円となりました。

純営業収益の内訳

	(百万円)		
	2019年度	2020年度	増減率
営業収益	672,287	576,172	△14.3%
受入手数料	266,574	286,835	7.6%
委託手数料	56,503	78,026	38.1%
引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料	29,818	38,098	27.8%
募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料	23,254	19,211	△17.4%
その他の受入手数料	156,997	151,499	△3.5%
トレーディング損益	93,802	118,895	26.8%
営業投資有価証券関連損益	14	4,808	342.4%
金融収益	258,122	93,188	△63.9%
その他の営業収益	53,772	72,444	34.7%
金融費用	209,916	54,480	△74.0%
その他の営業費用	36,110	55,031	52.4%
純営業収益	426,259	466,660	9.5%

連結収益の内訳

(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。

〈トレーディング損益の状況〉

トレーディング損益は、エクイティ・FICCともに増加し、同26.8%増の1,188億円となりました。

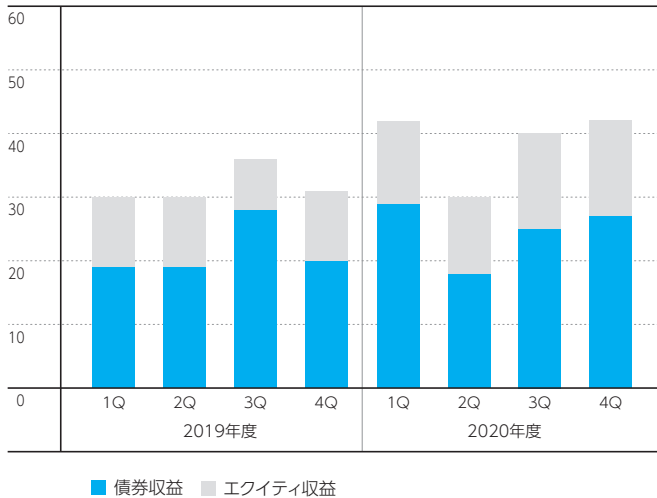
トレーディング損益とトレーディングに伴う金融収支を合計した管理会計ベースのエクイティ収益は同34.1%増の550億円となりました。債券収益は同15.1%増の990億円となりました。

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)		
	2019年度	2020年度	増減率
エクイティ収益	41.0	55.0	34.1%
債券収益	86.0	99.0	15.1%
合計	127.0	154.0	21.3%

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)
(百万円)



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・一般管理費は同0.5%増の3,738億円となりました。取引関係費は広告宣伝費及び旅費・交通費等の減少により同16.4%減の576億円、人件費は賞与等が増加したこと等により同4.9%増の1,930億円、減価償却費はシステムの更改等により同10.1%増の339億円となっております。

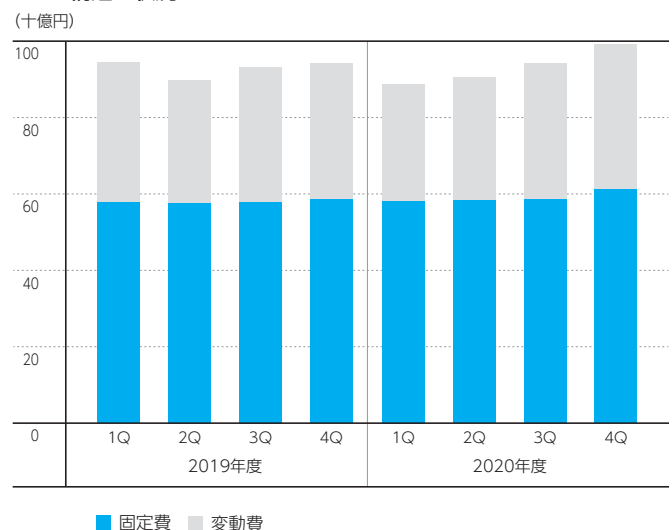
以上より、経常利益は同63.9%増の1,151億円となりました。

また、大和証券オフィス投資法人が連結子会社化したことに伴う段階取得に係る差益等により特別利益が516億円(前年度374億円)、収支構造の改善に向けた構造改革関連費用や減損損失及び投資損失引当金繰入額の計上により特別損失が222億円(前年度229億円)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79.6%増の1,083億円となりました。

販売費・一般管理費および収支の内訳

	2019年度	2020年度	増減率
販売費・一般管理費	371,970	373,800	0.5%
取引関係費	68,891	57,612	△16.4%
人件費	184,032	193,002	4.9%
不動産関係費	36,647	38,441	4.9%
事務費	25,969	24,365	△6.2%
減価償却費	30,813	33,920	10.1%
租税公課	10,529	11,493	9.2%
貸倒引当金繰入れ	170	281	65.3%
その他	14,917	14,682	△1.6%
営業利益	54,288	92,859	71.0%
営業外収支	15,995	22,316	39.5%
経常利益	70,283	115,175	63.9%
特別損益	14,546	29,391	102.1%
税金等調整前当期純利益	84,828	144,567	70.4%
法人税等合計	23,563	34,915	48.2%
親会社株主に帰属する当期純利益	60,346	108,396	79.6%

コスト構造の状況



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】

新型コロナウイルスの感染拡大の影響による初の緊急事態宣言が東京をはじめとする各地域で発出されたことから、第1四半期は商品募集・販売額が減少しましたが、当該緊急事態宣言の解除後は段階的に回復しました。一方で株式売買代金は第1四半期から好調で、株式相場の上昇にともない国内株・外国株ともに四半期ごとに増加しました。加えて、複数の大型エクイティ引受案件が貢献し、エクイティ収益が増加しました。また、リテール部門における販売費・一般管理費は収支構造改革の取組みの結果減少し、利益率が向上しました。

当連結会計年度のリテール部門における純営業収益は前年度比1.8%増の1,695億円、経常利益は同213.3%増の200億円となりました。

【ホールセール部門】

グローバル・マーケットでは良好なマーケット環境の中、リテール部門との連携によるタイムリーな商品提供、金利動向の変化を適切に捉えた債券などのトレーディング、及び市場環境の変化に対応した株式トレーディングが、収益に大きく貢献しました。フィクスト・インカム収益は第1四半期にJGBとクレジットの顧客フロー増加及びポジション運営が奏功し特に伸長しましたが、第2四半期以降も堅調に推移しました。その結果、当連結会計年度の純営業収益は前年度比33.3%増の1,617億円、経常利益は同122.7%増の627億円となりました。

グローバル・インベストメント・バンキングのエクイティ引受けは、新型コロナウイルスの影響で第1四半期には市場全体で案件数が減少しましたが、第2四半期以降、ソフトバンク株式会社や日本航空株式会社など複数の大型ファイナンスにおいてジョイント・グローバル・コーディネーターを務めたほか、株式会社ポピンズホールディングスによるSDGs-IPO(注1)、株式会社学研ホールディングスによるソーシャルPO(注2)など、多くの主幹事を務めました。デット引受けは新型コロナウイルスの影響で企業のニーズが堅調であったことに加え、国立大学法人東京大学によるソーシャルボンド(注3)などの本邦初となる案件の主幹事を務めました。当連結会計年度の引受け・売出し手数料は、前年度比27.8%増の380億円となりました。M&Aアドバイザリー業務では新型コロナウイルスの影響で第1四半期には案件の進行が遅れる等の影響がありましたが、一方で社会的な変化を受けて企業のM&Aニーズは増加しており、案件のパイプラインは第4四半期にかけて国内外で高水準となり、収益も回復しました。M&A関連手数料は前年度比7.6%減の266億円となりました。これらの結果、グローバル・インベストメント・バンキングの当連結会計年度の純営業収益は前年度比6.2%増の541億円となりました。経常利益は同18.1%増の110億円となりました。

当連結会計年度のホールセール部門における純営業収益は前年度比25.3%増の2,158億円、経常利益は同96.5%増の747億円となりました。

(注1)SDGs-IPO(Initial Public Offering)：新規株式公開時の株式公募において、その資金使途及び発行体について、SDGsへの貢献、ソーシャルボンド原則への準拠性についての評価を第三者評価機関から取得したもの。

(注2)ソーシャルPO(Public Offering)：ソーシャルボンド原則などに適合しているとの評価を第三者評価機関から取得したソーシャルエクイティ・ファイナンス・フレームワークに則って実施する公募による資金調達。

(注3)ソーシャルボンド：特定の社会的課題への対処や軽減、あるいはポジティブな社会的成果の達成を目指す新規又は既存のプロジェクトに必要な資金を調達するために発行する債券。

【アセット・マネジメント部門】

大和アセットマネジメントにおける公募株式投信及び公募公社債投信の運用資産残高は、資金純増の確保に加え相場の上昇も寄与し、主にETFの運用資産残高が増加し、前年度末比6.0兆円増の20.9兆円、うちETFの運用資産残高は前年度比4.4兆円増の11.8兆円となりました。大和アセットマネジメントの営業収益は前年度比6.0%減の659億円、経常利益は同6.5%減の146億円となりました。

不動産アセット・マネジメントでは、新規物件の取得や資産の入替を行い、大和リアル・エーステート・アセット・マネジメント及び、前連結会計年度中に連結子会社化したサムティ・レジデンシャル投資法人の2社を合わせた運用資産残高は1兆2,129億円となり、収益も増加しました。

その結果、当連結会計年度のアセット・マネジメント部門の純営業収益は前年度比6.3%増の511億円、経常利益は同23.3%増の327億円となりました。

【投資部門】

大和企業投資で投資先の上場などを通じた既存投資案件の回収を行ったほか、大和エネルギー・インフラでインカムゲインに加えキャピタルゲインを計上しました。当連結会計年度における投資部門の純営業収益は前年度比83.9%増の46億円、経常損益は前年度8億円の経常損失から11億円の経常利益となりました。

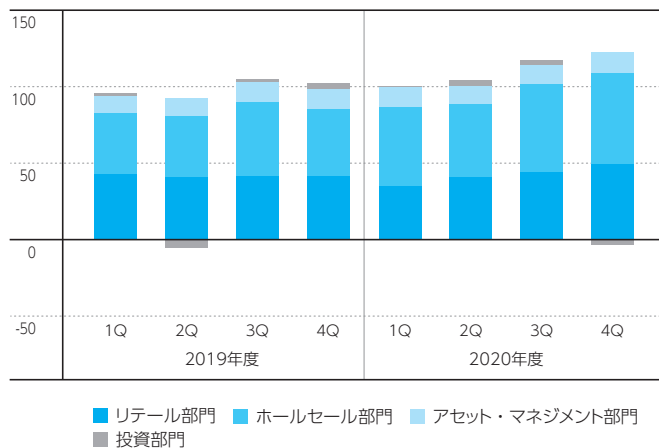
セグメント別業績

	純営業収益			経常利益		
	2019年度	2020年度	増減率	2019年度	2020年度	増減率
リテール部門	166,430	169,505	1.8%	6,405	20,070	213.3%
ホールセール部門	172,289	215,860	25.3%	38,034	74,737	96.5%
アセット・マネジメント部門	48,091	51,145	6.3%	26,580	32,775	23.3%
投資部門	2,502	4,602	83.9%	△877	1,123	—
その他・調整	36,943	25,546	—	140	△13,532	—
連結計	426,259	466,660	9.5%	70,283	115,175	63.9%

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

(百万円)



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〉

海外部門の業績は、経常利益で前年度比36.4%増の218億円となり、5年連続で通期黒字となりました。また、年度ベースの経常利益は、開示を開始した1999年以降で過去最高となりました。

当連結会計年度においては、M&Aビジネスへの取組みとして、ミッドキャップの案件獲得に引き続き注力しました。前年度に、当社の子会社である株式会社大和インターナショナル・ホールディングス傘下のDC Advisory Holdings Limitedを通じて、再生可能エネルギー分野に特化したフィナンシャル・アドバイザリー事業を行うGreen Giraffe Advisory B.V.へ50%出資したことで、欧州のDaiwa Corporate Advisoryが行うインフラ関連アドバイザリー事業を補完するとともに、再生可能エネルギーをはじめとするインフラ関連アドバイザリーのプラットフォームを強化しました。

8月には、中国証券監督管理委員会より、中国での合併証券会社設立に関する許可を受けました。当社は中国の関連法律に従い合併証券設立に必要な諸手続を経て、営業開始に向けて準備を進めていきます。新たに設立する大和証券(中国)有限公司では、当社のグローバル・ネットワークを生かし、中国及びグローバルで事業展開するお客様にハイクオリティな金融サービスを提供し、両国の資本市場の発展に貢献していきます。(※2021年6月に「経営証券先物業務許可証」(ライセンス)を受領しました。)

地域別では、欧州はエクイティ・FICCともに収益が増加したほか、M&A収益が増加し、経常利益は39億円(前年度は42億円の経常損失)となりました。

アジア・オセアニアでは、エクイティ・FICCともに収益が増加したほか、SSIの持分法投資利益が利益に貢献し、経常利益は前年度比79.1%増の46億円となりました。

米州は前年度高水準であったFICC収益が減少し、経常利益は前年度比25.3%減の131億円となりました。

地域別の経常収支

	(百万円)	
	2019年度	2020年度
欧州	△4,253	3,969
アジア・オセアニア	2,601	4,659
米州	17,644	13,188
合計	15,992	21,817

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2兆2,772億円(9.6%)増加の26兆993億円となりました。内訳は流動資産が同1兆7,996億円(7.9%)増加の24兆6,463億円であり、このうち現金・預金が同7,986億円(20.1%)増加の4兆7,631億円、トレーディング商品が同1,931億円(2.4%)減少の7兆8,340億円、営業貸付金が同2,276億円(12.9%)増加の1兆9,961億円、有価証券担保貸付金が同7,625億円(11.4%)増加の7兆4,483億円となっております。固定資産は同4,775億円(49.0%)増加の1兆4,530億円となっております。

〈負債の部・純資産の部〉

負債合計は前年度末比1兆9,431億円(8.6%)増加の24兆5,074億円となりました。内訳は流動負債が同1兆3,006億円(6.5%)増加の21兆2,193億円であり、このうちトレーディング商品が同9,944億円(18.5%)減少の4兆3,678億円、約定見返勘定が同7,755億円(142.4%)増加の1兆3,202億円、有価証券担保借入金金が同9,773億円(13.6%)増加の8兆1,760億円、銀行業における預金が同3,788億円(9.4%)増加の4兆4,160億円となっております。固定負債は同6,427億円(24.3%)増加の3兆2,844億円であり、このうち社債が同1,781億円(12.9%)増加の1兆5,573億円、長期借入金が同4,036億円(34.1%)増加の1兆5,869億円となっております。

純資産合計は同3,340億円(26.6%)増加の1兆5,918億円となりました。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1,083億円計上したほか、配当金304億円の支払いを行ったこと等により、同772億円(9.3%)増加の9,117億円となっております。自己株式の控除額は同27億円(2.5%)減少の1,076億円、その他有価証券評価差額金は同147億円(54.9%)増加の415億円、為替換算調整勘定は同184億円増加の128億円、非支配株主持分は6.4倍の2,491億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、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、トレーディング商品の増減、短期差入保証金の増減などにより、3,909億円(前年度は1,671億円)となりました。投資活動によるキャッシュ・フローは、有価証券の取得による支出、投資有価証券の取得による支出などにより、△916億円(同△2,153億円)となりました。財務活動によるキャッシュ・フローは、短期借入金の純増減などにより、4,380億円(同△1,357億円)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7,903億円増加の4兆7,235億円となりました。

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る有価証券関連業務や、投融資業務を行っており、これらの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、ミディアム・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161.2%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上で、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、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 2021年1月 至 2021年3月)		
適格流動資産	(A)	27,608
資金流出額	(B)	35,385
資金流入額	(C)	18,261
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)	27,608
純資金流出額	(E)	17,124
連結流動性カバレッジ比率	(D)/(E)	161.2%

〈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、当社グループ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。

〈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。

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。2021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	－
S&Pグローバル・レーティング・ジャパン	BBB+	A-2
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+	－

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
S&Pグローバル・レーティング・ジャパン	A－	A-2
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))

	2016年度	2017年度	2018年度	2019年度	2020年度
営業成績					
営業収益	616,497	712,601	720,586	672,287	576,172
受入手数料	273,335	313,625	283,027	266,574	286,835
トレーディング損益	128,120	109,005	92,218	93,802	118,895
営業投資有価証券関連損益	14,846	26,912	△232	14	4,808
金融収益	143,241	190,444	291,005	258,122	93,188
その他の営業収益	56,953	72,613	54,567	53,772	72,444
金融費用	98,725	148,348	242,468	209,916	54,480
その他の営業費用	45,022	58,901	36,876	36,110	55,031
純営業収益	472,750	505,350	441,240	426,259	466,660
販売費・一般管理費	353,687	370,292	373,914	371,970	373,800
営業利益又は営業損失(△)	119,062	135,058	67,326	54,288	92,859
経常利益又は経常損失(△)	135,623	155,676	83,159	70,283	115,175
親会社株主に帰属する当期純利益又は当期純損失(△)	104,067	110,579	63,813	60,346	108,396

財政状態(年度末)

総資産	19,827,296	21,135,041	21,126,706	23,822,099	26,099,330
純資産	1,343,433	1,370,520	1,256,430	1,257,766	1,591,841

1株当たり数値(円)

当期純利益又は当期純損失(△) *1	61.53	66.88	39.95	39.11	71.20
純資産	745.80	786.56	794.54	796.33	875.12
配当金	26.00	28.00	21.00	20.00	36.00

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)	11,258	11,339	10,868	11,718	13,052
普通株式等Tier1資本の額(A)	11,258	11,339	10,868	10,352	11,236
その他Tier1資本の額(B)	—	—	—	1,366	1,815
Tier2資本の額(C)	—	—	—	—	—
リスク・アセット合計(E)	50,614	52,058	50,208	55,363	60,083
信用リスク・アセットの額	26,475	27,194	25,150	29,916	38,346
マーケット・リスク相当額を8%で除して得た額	13,755	14,574	15,307	16,041	12,111
オペレーショナル・リスク相当額を8%で除して得た額	10,382	10,288	9,750	9,404	9,626
連結普通株式等Tier1比率(A) / (E)	22.2%	21.78%	21.64%	18.69%	18.70%
連結Tier1比率((A) + (B)) / (E)	22.2%	21.78%	21.64%	21.16%	21.72%
連結自己資本規制比率	—	—	—	—	—
連結総自己資本規制比率(D) / (E)	22.2%	21.78%	21.64%	21.16%	21.72%

*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	2020年3月期 (2020年3月31日現在)	2021年3月期 (2021年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産	22,846,637	24,646,314
現金・預金	3,964,512	4,763,197
預託金	415,953	485,876
受取手形及び売掛金	18,427	21,488
有価証券	873,064	996,683
トレーディング商品	8,027,289	7,834,093
商品有価証券等	4,300,600	5,374,191
デリバティブ取引	3,726,689	2,459,901
営業投資有価証券	202,557	97,092
投資損失引当金	△1,160	△588
営業貸付金	1,768,471	1,996,121
仕掛品	609	603
信用取引資産	114,384	162,078
信用取引貸付金	105,203	152,077
信用取引借証券担保金	9,180	10,001
有価証券担保貸付金	6,685,756	7,448,321
借入有価証券担保金	4,813,361	5,054,451
現先取引貸付金	1,872,394	2,393,870
立替金	25,682	20,131
短期貸付金	3,087	595
未収収益	36,483	36,229
その他の流動資産	711,935	788,790
貸倒引当金	△415	△4,401
固定資産	975,462	1,453,016
有形固定資産	309,166	880,477
建物	115,882	210,109
機械装置	8,004	9,251
器具備品	19,153	18,030
土地	127,751	598,541
建設仮勘定	38,375	44,544
無形固定資産	124,115	128,786
のれん	13,629	21,229
借地権	3,217	5,787
ソフトウェア	77,985	84,276
その他	29,283	17,493
投資その他の資産	542,179	443,751
投資有価証券	491,660	402,590
長期貸付金	5,915	6,313
長期差入保証金	17,877	17,692
繰延税金資産	17,125	11,397
その他	10,042	10,415
貸倒引当金	△440	△1,037
投資損失引当金	—	△3,620
資産合計	23,822,099	26,099,330

(単位：百万円)

科 目	2020年3月期 (2020年3月31日現在)	2021年3月期 (2021年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債	19,918,716	21,219,352
支払手形及び買掛金	8,938	5,382
トレーディング商品	5,362,261	4,367,822
商品有価証券等	1,805,910	2,032,969
デリバティブ取引	3,556,351	2,334,853
約定見返勘定	544,689	1,320,279
信用取引負債	59,256	64,022
信用取引借入金	3,994	4,139
信用取引貸証券受入金	55,261	59,882
有価証券担保借入金	7,198,730	8,176,094
有価証券貸借取引受入金	4,839,095	4,699,647
現先取引借入金	2,359,635	3,476,447
銀行業における預金	4,037,201	4,416,097
預り金	353,943	419,994
受入保証金	414,641	366,351
短期借入金	1,276,948	1,408,288
コマーシャル・ペーパー	178,000	265,000
1年内償還予定の社債	277,852	203,774
未払法人税等	7,403	17,962
賞与引当金	26,747	36,316
その他の流動負債	172,101	151,966
固定負債	2,641,697	3,284,436
社債	1,379,226	1,557,333
長期借入金	1,183,272	1,586,913
繰延税金負債	4,369	43,176
退職給付に係る負債	44,359	44,773
訴訟損失引当金	1,570	1,809
その他の固定負債	28,900	50,430
特別法上の準備金	3,918	3,699
金融商品取引責任準備金	3,918	3,699
負債合計	22,564,333	24,507,489
(純資産の部)		
株主資本	1,202,310	1,282,154
資本金	247,397	247,397
資本剰余金	230,808	230,651
利益剰余金	834,442	911,742
自己株式	△110,351	△107,646
自己株式申込証拠金	13	9
その他の包括利益累計額	7,703	51,415
その他有価証券評価差額金	26,853	41,587
繰延ヘッジ損益	△13,592	△3,058
為替換算調整勘定	△5,556	12,886
新株予約権	8,901	9,125
非支配株主持分	38,849	249,145
純資産合計	1,257,766	1,591,841
負債・純資産合計	23,822,099	26,099,330

連結損益計算書

(単位：百万円)

科 目	2020年3月期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	2021年3月期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益	672,287	576,172
受入手数料	266,574	286,835
委託手数料	56,503	78,026
引受け・売出し・特定投資家 向け売付け勧誘等の手数料	29,818	38,098
募集・売出し・特定投資家向け 売付け勧誘等の取扱手数料	23,254	19,211
その他の受入手数料	156,997	151,499
トレーディング損益	93,802	118,895
営業投資有価証券関連損益	14	4,808
金融収益	258,122	93,188
その他の営業収益	53,772	72,444
金融費用	209,916	54,480
その他の営業費用	36,110	55,031
純営業収益	426,259	466,660
販売費・一般管理費	371,970	373,800
取引関係費	68,891	57,612
人件費	184,032	193,002
不動産関係費	36,647	38,441
事務費	25,969	24,365
減価償却費	30,813	33,920
租税公課	10,529	11,493
貸倒引当金繰入れ	170	281
その他	14,917	14,682
営業利益	54,288	92,859
営業外収益	17,465	25,500
受取配当金	5,062	3,381
持分法による投資利益	8,586	12,369
投資事業組合運用益	—	5,539
その他	3,816	4,210
営業外費用	1,470	3,184
支払利息	269	636
為替差損	123	252
投資事業組合運用損	207	—
社債発行費	128	163
その他	741	2,132
経常利益	70,283	115,175

(右上に続く)

連結包括利益計算書

(単位：百万円)

科 目	2020年3月期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	2021年3月期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当期純利益	61,265	109,651
その他の包括利益		
その他有価証券評価差額金	△20,628	14,971
繰延ヘッジ損益	△7,934	10,345
為替換算調整勘定	△11,702	17,595
持分法適用会社に対する 持分相当額	△30	907
その他の包括利益合計	△40,296	43,819
包括利益	20,969	153,471
(内訳)		
親会社株主に係る包括利益	20,050	152,107
非支配株主に係る包括利益	919	1,363

(単位：百万円)

科 目	2020年3月期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	2021年3月期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
特別利益	37,476	51,650
固定資産売却益	8,749	57
投資有価証券売却益	12,442	4,231
段階取得に係る差益	4,642	46,962
持分変動利益	11,413	180
金融商品取引責任準備金戻入	19	218
その他	208	—
特別損失	22,930	22,259
固定資産除売却損	609	1,386
減損損失	1,283	9,394
投資有価証券売却損	—	219
投資有価証券評価損	8,114	1,738
関係会社株式評価損	—	896
投資損失引当金繰入額	—	3,620
構造改革関連費用	12,500	4,319
その他	422	684
税金等調整前当期純利益	84,828	144,567
法人税、住民税及び事業税	26,087	35,589
法人税等調整額	△2,524	△673
当期純利益	61,265	109,651
非支配株主に帰属する当期純利益	918	1,255
親会社株主に帰属する当期純利益	60,346	108,396

連結株主資本等変動計算書

2021年3月期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位：百万円)

項目	株主資本					
	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	株主資本合計
2020年4月1日残高	247,397	230,808	834,442	△110,351	13	1,202,310
連結会計年度中の変動額						
剰余金の配当	—	—	△30,429	—	—	△30,429
親会社株主に帰属する当期純利益	—	—	108,396	—	—	108,396
自己株式の取得	—	—	—	△9	—	△9
自己株式の処分	—	—	△667	2,714	—	2,047
その他	—	△157	—	—	△3	△160
連結会計年度中の変動額合計	—	△157	77,299	2,704	△3	79,843
2021年3月31日残高	247,397	230,651	911,742	△107,646	9	1,282,154

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		
2020年4月1日残高	26,853	△13,592	△5,556	8,901	38,849
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）	14,734	10,534	18,442	223	210,296
連結会計年度中の変動額合計	14,734	10,534	18,442	223	210,296
2021年3月31日残高	41,587	△3,058	12,886	9,125	249,145

2020年3月期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位：百万円)

項目	株主資本					
	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	株主資本合計
2019年4月1日残高	247,397	230,633	805,761	△87,320	5	1,196,476
連結会計年度中の変動額						
剰余金の配当	—	—	△31,164	—	—	△31,164
親会社株主に帰属する当期純利益	—	—	60,346	—	—	60,346
自己株式の取得	—	—	—	△25,102	—	△25,102
自己株式の処分	—	—	△501	2,071	—	1,570
その他	—	175	—	—	8	183
連結会計年度中の変動額合計	—	175	28,681	△23,030	8	5,834
2020年3月31日残高	247,397	230,808	834,442	△110,351	13	1,202,310

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		
2019年4月1日残高	47,668	△5,611	5,942	8,741	3,211
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）	△20,815	△7,981	△11,499	159	35,638
連結会計年度中の変動額合計	△20,815	△7,981	△11,499	159	35,638
2020年3月31日残高	26,853	△13,592	△5,556	8,901	38,849

連結キャッシュ・フロー計算書

(単位：百万円)

科 目	2020年3月期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	2021年3月期 (自 2020年4月1日 至 2021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	84,828	144,567
減価償却費	37,251	41,169
のれん償却額	1,254	1,167
貸倒引当金の増減額 (△は減少)	33	8,073
金融商品取引責任準備金の 増減額 (△は減少)	△19	△218
受取利息及び受取配当金	△5,118	△3,475
支払利息	269	636
持分法による投資損益 (△は益)	△8,586	△12,369
固定資産除売却損益 (△は益)	△8,139	1,328
投資有価証券売却損益 (△は益)	△12,442	△4,011
段階取得に係る差損益 (△は益)	△4,642	△46,962
持分変動損益 (△は益)	△11,413	△180
投資有価証券評価損益 (△は益)	8,114	1,738
減損損失	1,283	9,394
構造改革関連費用	12,500	4,319
顧客分別金信託の増減額 (△は増加)	△81,003	△50,304
トレーディング商品の増減額	△440,089	△41,577
営業投資有価証券の増減額 (△は増加)	△101,485	△8,691
営業貸付金の増減額 (△は増加)	△208,450	△221,448
信用取引資産及び 信用取引負債の増減額	49,924	△42,928
有価証券担保貸付金及び 有価証券担保借入金の増減額	534,755	219,893
短期貸付金の増減額 (△は増加)	79	31
銀行業における預金の増減額 (△は減少)	404,625	378,895
短期差入保証金の増減額 (△は増加)	△230,468	127,848
受入保証金の増減額 (△は減少)	42,485	△48,841
預り金の増減額 (△は減少)	80,222	63,121
その他	31,146	△119,354
小計	176,916	401,821
利息及び配当金の受取額	12,381	11,661
利息の支払額	△269	△615
法人税等の支払額又は還付額 (△は支払)	△21,838	△21,888
営業活動による キャッシュ・フロー	167,190	390,979

(右上に続く)

(単位：百万円)

科 目	2020年3月期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	2021年3月期 (自 2020年4月1日 至 2021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	△44,579	△64,698
定期預金の払戻による収入	43,883	58,018
有価証券の取得による支出	△517,970	△623,456
有価証券の売却及び 償還による収入	489,804	570,283
有形固定資産の取得による支出	△21,799	△29,329
有形固定資産の売却による収入	13,173	4,665
無形固定資産の取得による支出	△36,174	△29,271
投資有価証券の取得による支出	△141,453	△53,674
投資有価証券の売却及び 償還による収入	35,488	105,641
関係会社株式の取得による支出	△41,179	△28,925
連結の範囲の変更を伴う 子会社株式の取得による収入	7,367	—
貸付けによる支出	△437	△595
貸付金の回収による収入	34	76
その他	△1,553	△374
投資活動による キャッシュ・フロー	△215,397	△91,641
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)	51,079	419,571
長期借入れによる収入	148,629	277,190
長期借入金の返済による支出	△383,899	△320,854
社債の発行による収入	420,195	690,484
社債の償還による支出	△314,070	△601,407
自己株式の売却による収入	622	1,086
自己株式の取得による支出	△25,102	△9
配当金の支払額	△31,164	△30,429
連結子会社設立に伴う 非支配株主からの払込による収入	—	7,781
その他	△2,083	△5,344
財務活動による キャッシュ・フロー	△135,794	438,067
現金及び現金同等物に係る 換算差額	△4,950	6,796
現金及び現金同等物の増減額 (△は減少)	△188,952	744,201
現金及び現金同等物の期首残高	4,122,102	3,933,149
新規連結に伴う現金及び 現金同等物の増加額	—	25,968
連結の範囲の変更に伴う現金及び 現金同等物の増減額 (△は減少)	—	20,206
現金及び現金同等物の期末残高	3,933,149	4,723,526

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 66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(注)
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
サムティ・レジデンシャル投資法人
大和証券キャピタル・マーケットヨーロッパリミテッド
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
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.
大和証券キャピタル・マーケットアメリカInc.

当連結会計年度において、サムティ・レジデンシャル投資法人は、追加取得により持分比率が増加したため、持分法適用の関連会社から除外し、連結子会社としております。また、新規設立により5社を連結の範囲に含めております。

(注) 大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日に大和アセットマネジメント株式会社に商号変更しております。

(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

グッドタイムリビング株式会社
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 6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。

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 118社

主要な連結子会社の名称

大和証券株式会社
大和アセットマネジメント株式会社
株式会社大和総研ホールディングス(注)
株式会社大和証券ビジネスセンター
大和証券ファシリティーズ株式会社
株式会社大和ネクスト銀行
株式会社大和総研(注)
株式会社大和総研ビジネス・イノベーション(注)
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
大和証券オフィス投資法人
サムティ・レジデンシャル投資法人
大和証券キャピタル・マーケットヨーロッパリミテッド
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
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.
大和証券キャピタル・マーケットアメリカInc.

(注) 2021年4月1日に株式会社大和総研ホールディングスは、株式会社大和総研及び株式会社大和総研ビジネス・イノベーションを吸収合併し、株式会社大和総研へ商号変更しております。

当連結会計年度において、大和証券オフィス投資法人は、同法人による自己投資口の取得により当社グループの持分比率が増加したため、持分法適用の関連会社から除外し、連結子会社としております。また、ハイブリッド事業の進展に伴い質的・金銭的に重要性が高まったことにより主に匿名組合・合同会社等の50社を連結の範囲に含めております。その他に、新規設立により3社、重要性が高まったことにより1社を連結の範囲に含めております。また、合併消滅により2社、清算により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 7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。

2020年3月期

(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6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677,458百万円であります。

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 15社

主要な持分法適用の関連会社の名称

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

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4社、新規設立により2社、合併により1社を持分法の適用範囲に含めております。また、サムティ・レジデンシャル投資法人が持分比率の上昇に伴い持分法適用の関連会社から連結子会社となったことにより1社、合併消滅により1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、2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

グッドタイムリビング株式会社

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 12社

関連会社としなかった主要な会社の名称

NJT銅管株式会社

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	60社
1月及び7月	1社
12月	5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、4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。

2021年3月期

(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6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748,788百万円であります。

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 17社

主要な持分法適用の関連会社の名称

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

大和証券リビング投資法人

当連結会計年度において、株式の新規取得により1社、投資口の追加取得により1社、新規設立により1社を持分法の適用範囲に含めております。また、持分比率の上昇に伴い、持分法適用の関連会社から連結子会社となったことにより1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、2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 9社

関連会社としなかった主要な会社の名称

NJT銅管株式会社

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。

1月	11社
2月	3社
3月	75社
11月	1社
12月	26社
1月及び7月	1社
5月及び11月	1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、38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5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、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。

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。

なお、デリバティブ取引については、特定の市場リスク及び特定の信用リスクの評価に関して、金融資産及び金融負債を相殺した後の正味の資産又は負債を基礎として、当該金融資産及び金融負債のグループを単位とした時価を算定しております。

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

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

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、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 棚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、キャッシュ・フロー見積法により計上しております。

② 投資損失引当金

当社及び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及び非連結子会社株式から生じる損失に備えるため、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・負債から生ず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。

③ 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社及び一部の国内連結子会社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

(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・負債から生ず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 2020年10月8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。

③ 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社及び一部の国内連結子会社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

5. 会計方針の変更に関する注記

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当連結会計年度の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用しております。これによる連結計算書類に与える影響はありません。

また、「金融商品に関する注記」において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。

6. 表示方法の変更に関する注記

「会計上の見積りに関する会計基準」(企業会計基準第31号 2020年3月31日)を当連結会計年度の年度末に係る連結計算書類から適用し、連結計算書類に重要な会計上の見積りに関する注記を記載しております。

7. 会計上の見積りに関する注記

会計上の見積りにより当連結会計年度に係る連結計算書類にその額を計上した項目であって、翌連結会計年度に係る連結計算書類に重要な影響を及ぼす可能性のあるものは、次のとおりです。

(1) トレーディング商品に属するレベル3のデリバティブ取引に係る評価

① 当連結会計年度に係る連結計算書類に計上した額

トレーディング商品に属するデリバティブ取引のうち、レベル3に区分されている資産は470億円、負債は198億円であり、市場で観察できないインプットを使用して時価を算定していることから見積りの不確実性があります。

② 識別した項目に係る重要な会計上の見積りの内容に関する理解に資する情報

トレーディング商品に属するデリバティブ取引の時価は、リスク中立測定下での期待キャッシュ・フロー・ディスカウント・モデルにより算定しております。

この時価算定の会計上の見積りにおける主要な仮定は価格算定モデルに用いるインプットであります。価格算定モデルには、金利、為替レート、株価、ボラティリティ、相関係数などの様々なインプットを使用しており、特に、レベル3のデリバティブ取引の時価の算定には、長期のスワップ・レート、長期の通貨ベース、長期の株価ボラティリティ、長期のクレジット・スプレッド及び相関係数といった市場で観察できないインプットを使用しております。

これらの内容は、「金融商品に関する注記(注)1 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明」に記載しております。市場環境の変化等による主要な仮定の変化が、翌連結会計年度の連結計算書類においてトレーディング商品の評価額に重要な影響を及ぼす可能性があります。重要な観察できないインプットを変化させた場合の時価に対する影響については、「金融商品に関する注記(注)2 時価で連結貸借対照表に計上している金融商品のうちレベル3の時価に関する情報」に記載しております。

(2) 営業投資有価証券・営業貸付金(投資部門)の評価

① 当連結会計年度に係る連結計算書類に計上した額

営業投資有価証券	97,092百万円
投資損失引当金	△588
営業貸付金(投資部門)	68,279
貸倒引当金(投資部門)	△3,986
計	160,796

当社グループの投資部門に属する連結子会社である大和PIパートナーズ株式会社及び大和エナジー・インフラ株式会社は、プライベート・エクイティ、不動産、エネルギー、インフラストラクチャーなどを対象に、主に営業投資有価証券等のトレーディング商品に属さない有価証券及び営業貸付金等を通じて投融資を行っております。当連結会計年度末において、投資部門が上記で記載されている残高を計上しております。

② 識別した項目に係る重要な会計上の見積りの内容に関する理解に資する情報

投資先の財政状態、直近の事業環境とそれを反映させた事業計画等を基礎とした見積将来キャッシュ・フローの現在価値、類似企業の取引事例から観測されるマルチプル等を利用して算定された資産の評価額には見積りの不確実性が含まれております。当該評価額に基づいて、減損損失、投資損失引当金及び貸倒引当金の計上が行われます。当連結会計年度においては、ミャンマー関連投資で18億円、航空機関連投資で9億円、不採算の国内外のファンド投資等で124億円の損失を計上しております。

資産の評価額の算定にあたり、見積将来キャッシュ・フローを用いる場合は、投資先の業績、投資先が属する産業の動向及び新型コロナウイルス感染症の拡大の影響等を考慮し、経営者が妥当と判断する仮定を使用して見積りを行っております。一部の投資の評価において、将来キャッシュ・フローの見積りの前提として使用した主要な仮定は、以下のとおりです。

- ・ 航空機関連投資 : 新型コロナウイルス感染症の拡大による影響から航空業界が回復する時期の見通し
- ・ エネルギー関連投資 : 輸入燃料価格の動向や我が国の再生可能エネルギー推進に関する展望

2020年3月期

2021年3月期

会計上の見積りを行うにあたっては、新型コロナウイルス感染症の感染拡大による影響は2023年3月期末頃までは継続し、その後は緩やかに終息に向かうとの仮定を置いております。新型コロナウイルス感染症の感染拡大の影響を相対的に大きく受ける航空機関連投資については、新型コロナウイルス感染症による影響の長期化も踏まえて再評価を実施しております。

これらの資産の評価で使用される見積りや仮定には不確実性が伴うため、将来の予測不能な前提条件の変化などにより、評価に関する会計上の見積りが変動した場合には、翌連結会計年度の連結計算書類において追加の損失又は引当金の戻入を認識する可能性があります。

表示方法の変更

該当事項はありません。

該当事項はありません。

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

有価証券	92,385百万円
トレーディング商品	531,870
営業貸付金	845,230
投資有価証券	18,095
計	1,487,581

(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185,873百万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	3,994百万円
短期借入金	442,439
長期借入金	294,800
計	741,233

(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。

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	5,853,262百万円
現先取引で売却した有価証券	2,064,787
その他	461,924
計	8,379,973

(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	5,888,916百万円
現先取引で買い付けた有価証券	1,565,430
その他	242,713
計	7,697,060

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	6,147百万円
--------------	----------

5. 有形固定資産の減価償却累計額

123,783百万円

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	29
グッドタイムリビング株式会社	入居一時金等返還債務	12,115
その他	債務	15
計		12,160

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	3,557百万円
有価証券	71,260
トレーディング商品	411,636
営業貸付金	887,425
その他の流動資産	62,518
投資有価証券	24,673
計	1,461,071

(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110,186百万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	4,139百万円
短期借入金	252,161
社債	800
長期借入金	489,722
その他の固定負債	312
計	747,135

(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。

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	5,486,331百万円
現先取引で売却した有価証券	3,017,724
その他	426,043
計	8,930,098

(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	5,838,082百万円
現先取引で買い付けた有価証券	1,916,399
その他	354,628
計	8,109,109

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	9,253百万円
--------------	----------

5. 有形固定資産の減価償却累計額

163,301百万円

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	18
グッドタイムリビング株式会社	入居一時金等返還債務	11,929
計		11,948

2020年3月期

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

2021年3月期

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
2019年5月16日 取締役会	普通 株式	14,096	9	2019年 3月31日	2019年 6月3日
2019年10月30日 取締役会	普通 株式	17,067	11	2019年 9月30日	2019年 12月2日
計		31,164			

(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

2020年5月8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 13,675百万円
 ②1株当たり配当額 9円
 ③基準日 2020年3月31日
 ④効力発生日 2020年6月1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
2020年5月8日 取締役会	普通 株式	13,675	9	2020年 3月31日	2020年 6月1日
2020年10月29日 取締役会	普通 株式	16,754	11	2020年 9月30日	2020年 12月1日
計		30,429			

(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

2021年4月28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 38,096百万円
 ②1株当たり配当額 25円
 ③基準日 2021年3月31日
 ④効力発生日 2021年6月1日

(注) 配当原資は利益剰余金とする予定であります。

2020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	
		当連結会計 年度期首	増加	減少	当連結会計 年度末	年度末残高 (百万円)
当社	2006年7月発行 新株予約権	119,000	—	23,000	96,000	130
	2007年7月発行 新株予約権	160,000	—	26,000	134,000	175
	2008年7月発行 新株予約権	202,000	—	35,000	167,000	162
	2009年7月発行 新株予約権	450,000	—	54,000	396,000	229
	第6回新株予約権 (自己新株予約権)	1,383,000 (323,000)	— (—)	1,383,000 (323,000)	— (—)	— (—)
	2010年7月発行 新株予約権	820,000	—	92,000	728,000	273
	第7回新株予約権 (自己新株予約権)	2,598,000 (490,000)	— (8,000)	535,000 (—)	2,063,000 (498,000)	171 (—)
	2011年7月発行 新株予約権	1,036,000	—	39,000	997,000	356
	第8回新株予約権 (自己新株予約権)	2,443,000 (460,000)	— (10,000)	288,000 (—)	2,155,000 (470,000)	192 (—)
	2013年2月発行 新株予約権	738,000	—	16,000	722,000	410
	第9回新株予約権 (自己新株予約権)	4,998,000 (461,000)	— (77,000)	77,000 (—)	4,921,000 (538,000)	962 (—)
	2014年2月発行 新株予約権	375,000	—	15,000	360,000	344
	第10回新株予約権 (自己新株予約権)	3,680,000 (283,000)	— (83,000)	83,000 (—)	3,597,000 (366,000)	1,082 (—)
	2015年2月発行 新株予約権	441,000	—	3,000	438,000	372
	第11回新株予約権 (自己新株予約権)	5,065,000 (353,000)	— (129,000)	129,000 (—)	4,936,000 (482,000)	951 (—)
	2016年2月発行 新株予約権	567,000	—	8,000	559,000	370
	第12回新株予約権 (自己新株予約権)	4,228,000 (256,000)	— (96,000)	96,000 (—)	4,132,000 (352,000)	472 (—)
	2017年2月発行 新株予約権	571,000	—	8,000	563,000	398
	第13回新株予約権 (自己新株予約権)	7,165,000 (283,000)	— (190,000)	190,000 (—)	6,975,000 (473,000)	639 (—)
	2018年2月発行 新株予約権	599,000	—	4,000	595,000	432
	第14回新株予約権 (自己新株予約権)	7,287,000 (175,000)	— (223,000)	223,000 (—)	7,064,000 (398,000)	445 (—)
	第15回新株予約権 (自己新株予約権)	7,388,000 (81,500)	— (219,500)	219,500 (—)	7,168,500 (301,000)	264 (—)
	第16回新株予約権 (自己新株予約権)	— (—)	8,462,500 (169,000)	169,000 (—)	8,293,500 (169,000)	62 (—)
	合計					8,901 (—)

(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12回新株予約権」、「第13回新株予約権」、「第14回新株予約権」、「第15回新株予約権」及び「第16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。

2021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	
		当連結会計 年度期首	増加	減少	当連結会計 年度末	年度末残高 (百万円)
当社	2006年7月発行 新株予約権	96,000	—	27,000	69,000	94
	2007年7月発行 新株予約権	134,000	—	32,000	102,000	133
	2008年7月発行 新株予約権	167,000	—	37,000	130,000	126
	2009年7月発行 新株予約権	396,000	—	67,000	329,000	190
	2010年7月発行 新株予約権	728,000	—	63,000	665,000	249
	第7回新株予約権 (自己新株予約権)	2,063,000 (498,000)	— (—)	2,063,000 (498,000)	— (—)	— (—)
	2011年7月発行 新株予約権	997,000	—	49,000	948,000	339
	第8回新株予約権 (自己新株予約権)	2,155,000 (470,000)	— (2,000)	760,000 (—)	1,395,000 (472,000)	124 (—)
	2013年2月発行 新株予約権	722,000	—	27,000	695,000	394
	第9回新株予約権 (自己新株予約権)	4,921,000 (538,000)	— (56,000)	57,000 (—)	4,864,000 (594,000)	947 (—)
	2014年2月発行 新株予約権	360,000	—	9,000	351,000	335
	第10回新株予約権 (自己新株予約権)	3,597,000 (366,000)	— (50,000)	50,000 (—)	3,547,000 (416,000)	1,058 (—)
	2015年2月発行 新株予約権	438,000	—	9,000	429,000	364
	第11回新株予約権 (自己新株予約権)	4,936,000 (482,000)	— (96,000)	96,000 (—)	4,840,000 (578,000)	928 (—)
	2016年2月発行 新株予約権	559,000	—	7,000	552,000	366
	第12回新株予約権 (自己新株予約権)	4,132,000 (352,000)	— (77,000)	78,000 (—)	4,054,000 (429,000)	489 (—)
	2017年2月発行 新株予約権	563,000	—	7,000	556,000	393
	第13回新株予約権 (自己新株予約権)	6,975,000 (473,000)	— (142,000)	142,000 (—)	6,833,000 (615,000)	845 (—)
	2018年2月発行 新株予約権	595,000	—	4,000	591,000	429
	第14回新株予約権 (自己新株予約権)	7,064,000 (398,000)	— (153,000)	153,000 (—)	6,911,000 (551,000)	653 (—)
	第15回新株予約権 (自己新株予約権)	7,168,500 (301,000)	— (162,000)	162,000 (—)	7,006,500 (463,000)	422 (—)
	第16回新株予約権 (自己新株予約権)	8,293,500 (169,000)	— (220,500)	220,500 (—)	8,073,000 (389,500)	156 (—)
	第17回新株予約権 (自己新株予約権)	— (—)	7,920,000 (115,000)	115,000 (—)	7,805,000 (115,000)	80 (—)
	合計					9,125 (—)

(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13回新株予約権」、「第14回新株予約権」、「第15回新株予約権」、「第16回新株予約権」及び「第17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務や投融資業務を行っております。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、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うえで十分な流動性を効率的かつ安定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を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、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、レボ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こと、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。

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うえで十分な流動性を効率的かつ安定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。これらの他、関連するリスクとしてモデルリスクがあります。モデルリスクとは、モデルの開発、実装における誤り、又はモデルの誤用に起因して、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を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、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、レボ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などにより資金繰りに支障をきたすこと、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12億円であります。

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。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。

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。

(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、VaR、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12億円であります。

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。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。

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。

(iii) モデルリスクの管理

トレーディング商品の時価評価モデルは、モデルリスク管理体制のもと、検証・承認のプロセスを経てモデルの妥当性を確認したのちに使用されます。また、市場実勢の変化に伴い、不測のモデルリスクが発生することを防止するため、市場動向に合うよう定期的にレビューを行っております。

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にも、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、2020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92億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、2020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ベーシス・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。2020年3月31日現在における当該数値は57億円であります。

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。2019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。

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にも、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、2021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124億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、2021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ベーシス・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。2021年3月31日現在における当該数値は63億円であります。

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。2020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、レバ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、1年以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、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。

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る有価証券関連業務や、投融資業務を行っており、これらの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、レバ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、1年以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、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。

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。

2020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	3,964,512	3,964,512	—
(2) 預託金	415,953	415,953	—
(3) トレーディング商品			
① 商品有価証券等	4,300,600	4,300,600	—
② デリバティブ取引	3,726,689	3,726,689	—
(4) 営業貸付金	1,768,471		
貸倒引当金	△108		
	1,768,363	1,747,320	△21,042
(5) 信用取引資産			
信用取引貸付金	105,203	105,203	—
信用取引借証券担保金	9,180	9,180	—
(6) 有価証券担保貸付金			
借入有価証券担保金	4,813,361	4,813,361	—
現先取引貸付金	1,872,394	1,872,394	—
(7) 有価証券、営業投資有価証券及び投資有価証券			
① 満期保有目的の債券	141,696	142,552	855
② 子会社株式及び関連会社株式	117,314		
投資損失引当金	—		
	117,314	131,349	14,034
③ その他有価証券	910,396	910,396	—
資産計	22,145,665	22,139,514	△6,151
負債			
(1) トレーディング商品			
① 商品有価証券等	1,805,910	1,805,910	—
② デリバティブ取引	3,556,351	3,556,351	—
(2) 約定見返勘定	544,689	544,689	—
(3) 信用取引負債			
信用取引借入金	3,994	3,994	—
信用取引貸証券受入金	55,261	55,261	—
(4) 有価証券担保借入金			
有価証券貸借取引受入金	4,839,095	4,839,095	—
現先取引借入金	2,359,635	2,359,635	—
(5) 銀行業における預金	4,037,201	4,038,440	△1,238
(6) 預り金	353,943	353,943	—
(7) 受入保証金	414,641	414,641	—
(8) 短期借入金	1,276,948	1,276,948	—
(9) コマーシャル・ペーパー	178,000	178,000	—
(10) 1年内償還予定の社債	277,852	277,852	—
(11) 社債	1,379,226	1,378,321	904
(12) 長期借入金	1,183,272	1,179,227	4,044
負債計	22,266,024	22,262,313	3,710
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	△4,073	△4,073	—
ヘッジ会計が適用されているもの	△22,097	△22,062	35
トレーディングに係るもの以外のデリバティブ取引計	△26,171	△26,135	35

※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。

2021年3月期

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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、企業会計基準適用指針第31号「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(以下、「時価算定適用指針」という。)第26項に従い経過措置を適用した投資信託、市場価格のない株式等及び時価算定適用指針第27項に従い経過措置を適用した組合出資金等については、表には含めておりません((1)※3、(注)3に記載のとおりであります)。

金融商品の時価を、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価： 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価： 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価： 観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価で連結貸借対照表に計上している金融商品

(単位：百万円)

	時価			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
資産				
(1) トレーディング商品				
① 商品有価証券等				
株券・ワラント	97,711	761	84	98,557
国債・地方債等	1,535,114	261,692	—	1,796,807
一般事業債	5,978	320,058	1,305	327,343
外国債券	1,027,327	308,726	6,151	1,342,205
その他	—	1,592,556	1,261	1,593,817
② デリバティブ取引				
エクイティ	21,850	157,971	28,822	208,643
金利	948	1,712,457	9,229	1,722,634
通貨	2	503,484	4,119	507,606
クレジット・その他	—	16,187	4,829	21,017
(2) 有価証券、営業投資有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券				
株券・ワラント	129,074	—	—	129,074
国債・地方債等	204,272	11,929	—	216,201
一般事業債	—	181,839	18,859	200,698
外国債券	100,268	230,094	12,216	342,578
資産計	3,122,549	5,297,759	86,878	8,507,187
負債				
(1) トレーディング商品				
① 商品有価証券等				
株券・ワラント	204,605	2,075	—	206,681
国債・地方債等	971,348	—	—	971,348
外国債券	769,608	23,483	—	793,092
その他	—	61,835	—	61,835
② デリバティブ取引				
エクイティ	57,998	153,190	8,807	219,996
金利	117	1,637,156	6,032	1,643,306
通貨	17	440,052	249	440,319
クレジット・その他	—	26,436	4,793	31,229
負債計	2,003,697	2,344,230	19,883	4,367,811
トレーディングに係るもの以外のデリバティブ取引(※1、※2)				
通貨	—	△2,122	—	△2,122
トレーディングに係るもの以外のデリバティブ取引計	—	△2,122	—	△2,122

2020年3月期

(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) 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については、貸出金の種類、期間等に基づき、元金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。また、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。ただし、一部の資産流動化ローンについては、第三者から入手した時価を使用しております。

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。

2021年3月期

※1 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。

※2 デリバティブ取引のうち、ヘッジ会計を適用している取引の連結貸借対照表計上額は△10,590百万円となります。

※3 「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等」の一部を改正する内閣府令(令和2年3月6日内閣府令第9号)附則第5条第6項の経過措置を適用した投資信託については、上記表には含めておりません。連結貸借対照表における当該投資信託の金額は、商品有価証券等において資産215,460百万円、負債10百万円、その他有価証券において資産125,934百万円であります。

※4 当社およ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かかる金利変動リスク及び為替変動リスクを回避するために、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、主に、繰延ヘッジを適用しております。なお、これらのヘッジ関係は、「LIBORを参照する金融商品に関するヘッジ会計の取扱い」(実務対応報告第40号 2020年9月29日)を適用しております。

(2) 時価で連結貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品

(単位：百万円)

	時価				連結貸借 対照表計上額	差額
	レベル1	レベル2	レベル3	合計		
資産						
(1) 営業貸付金 貸倒引当金					1,996,121 △4,036	
	—	—	1,992,190	1,992,190	1,992,084	105
有価証券、 (2) 営業投資有価証券 及び投資有価証券						
① 満期保有目的の債券 一般事業債	—	155,717	—	155,717	155,384	333
② 子会社 及び関連会社株式	73,220	—	—	73,220	56,812	16,407
資産計	73,220	155,717	1,992,190	2,221,127	2,204,281	16,846
負債						
(1) 銀行業における預金	—	4,415,643	—	4,415,643	4,416,097	453
(2) 社債	—	1,560,395	—	1,560,395	1,557,333	△3,062
(3) 長期借入金	—	1,584,931	—	1,584,931	1,586,913	1,982
負債計	—	7,560,970	—	7,560,970	7,560,344	△626

なお、「現金・預金」「預託金」「約定見返勘定」「有価証券担保貸付金」「有価証券担保借入金」「預り金」「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」等は、現金であること、または短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似するものであることから、記載を省略しております。また、以下の勘定科目は、その勘定の性質から短期間で決済されるとみなし、時価は帳簿価額と近似していることから、記載を省略しております。

ア 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しております。

イ 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)を時価とみなしてしております。

2020年3月期

(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。

(サ)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。

(シ)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。

(ス)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。

(セ)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。

(ソ)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)「②子会社株式及び関連会社株式」及び「③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	99,654
その他有価証券	
非上場株式	32,181
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	237,284
その他	28,753

(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。

2021年3月期

(注)1 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

(1)トレーディング商品

①商品有価証券等

株式等については、主たる取引所の最終価格又は最終気配値を時価としており、主にレベル1の時価に分類しております。

債券については、主に類似の債券を含めた市場価格(当社店頭、ブローカースクリーン等)または、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を時価としており、一部国債等はレベル1の時価に分類し、それ以外はレベル2の時価に分類しております。ただし、レベル2の時価と分類するのに必要な価格情報が得られない場合はレベル3の時価に分類しております。また、一部債券の時価については、デリバティブ取引と同様に価格算定モデルにより算定しております。観察可能なインプットのみを用いて価格を算定している場合、もしくは観察できないインプットを用いて価格を算定している場合、レベル2の時価に分類し、重要な観察できないインプットを用いて価格を算定している場合はレベル3の時価に分類しております。

投資信託については、取引所の最終価格若しくは最終気配値又は基準価額を時価としております。ただし、レベルの分類については、時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、レベルを付しておりません。

②デリバティブ取引

上場デリバティブ取引は、主に取引所の清算値価格又は証拠金算定基準価格を時価としており、レベル1の時価に分類しております。ただし、上記価格が得られない場合や取引が頻繁に行われていない場合は、レベル2の時価と分類しております。

店頭デリバティブ取引については、金利スワップ、通貨スワップ、エクイティ・デリバティブ、クレジット・デリバティブといった取引があります。時価の算定においては、市場で一般に用いられるリスク中立測度の仮定のもとでの期待キャッシュ・フローの現在価値を、主に数値積分法、有限差分法及びモンテカルロ法による価格算定モデルにより算定しております。価格算定モデルには、金利、為替レート、株価、ボラティリティ、相関係数などの様々なインプットがあります。観察可能なインプットのみを用いて価格を算定している場合、もしくは観察できないインプットを用いて価格を算定している場合、レベル2の時価に分類し、重要な観察できないインプットを用いて価格を算定している場合はレベル3の時価に分類しております。市場で観察できないインプットとしては、長期のスワップ・レート、長期の通貨ベース、長期の株価ボラティリティ、長期のクレジット・スプレッド及び相関係数があります。

なお、店頭デリバティブ取引については、取引相手先及び当社の信用リスク相当額、流動性リスク相当額を必要に応じて時価に調整しております。

(2)有価証券、営業投資有価証券及び投資有価証券

株式については、主たる取引所の最終価格又は最終気配値を時価としており、レベル1の時価に分類しております。

債券については、主に類似の債券を含めた市場価格(当社店頭、ブローカースクリーン等)または、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を時価としており、一部国債等はレベル1の時価に分類し、それ以外はレベル2の時価に分類しております。ただし、レベル2の時価と分類するのに必要な価格情報が得られない場合はレベル3の時価に分類しております。また、一部の債券(転換社債を含む)の時価については、クレジット・スプレッド、株価ボラティリティ等を用いて算定しております。観察可能なインプットのみを用いて価格を算定している場合、もしくは観察できないインプットを用いて価格を算定している場合、レベル2の時価に分類し、重要な観察できないインプットを用いて価格を算定している場合はレベル3の時価に分類しております。

投資信託については、取引所の最終価格若しくは最終気配値又は基準価額を時価としております。ただし、レベルの分類については、時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、レベルを付しておりません。

(3)トレーディングに係るもの以外のデリバティブ取引

「(1)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。

(4) 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については、貸出金の種類、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。また、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っていない限り、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。ただし、一部の資産流動化ローンについては、第三者から入手した時価を使用しております。

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。

投資業務における貸出金については、事業からの返済を中心とした債権の簿価が一定額以上の場合には、財政状態等をもとに個別評価しております。また、回収期間が一定年数を経過した債権については、貸倒引当金を担保の処分可能見込額及び保証による回収見込額、または将来キャッシュ・フローの見積額の現在価値等に基づいて算出していることから、時価は連結貸借対照表計上額から貸倒引当金を控除した金額に近似しているため、当該価額をもって時価としております。

これらについては、レベル3の時価に分類しております。

(5) 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。これらについては、レベル2の時価に分類しております。

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。

(6) 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、レベル2の時価に分類しております。市場価格が入手不可能な場合においても、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時価を算定しており、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いることから、レベル2の時価に分類しております。

(7) 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時価を算定しており、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いることから、レベル2の時価に分類しております。

(注) 2 時価で連結貸借対照表に計上している金融商品のうちレベル3の時価に関する情報

(1) 重要な観察できないインプットに関する定量的情報

区分	評価技法	重要な観察できないインプット	インプットの範囲
デリバティブ取引	リスク中立測度下での期待キャッシュ・フロー・ディスカウント・モデル		
金利・為替		スワップ・レート	△0.1-2.3%
エクイティ		通貨ベースス	△0.8-0.4%
		株価ボラティリティ	19.1-22.1%
		クレジット・スプレッド	0.1-4.1%
クレジット・その他		相関係数	△0.06-0.90
その他有価証券		クレジット・スプレッド	0.2-2.1%
		株価ボラティリティ	26.4-55.4%

(2) 期首残高から期末残高への調整表、当連結会計年度の損益に認識した評価損益

レベル3の時価をもって連結貸借対照表価額とする資産及び負債の内訳及び期中における変動は以下のとおりであります。

	商品有価証券等 (資産)	デリバティブ取引 (純額)	営業投資 有価証券	その他 有価証券	合計
期首残高	17,717	67,416	103	24,825	110,063
当連結会計年度の損益					
損益に計上(※2)	737	△13,714	—	—	△12,977
購入、売却、発行及び決済					
購入	40,587	2,238	128	5,120	48,074
売却	△43,203	△16	—	—	△43,220
発行	—	—	—	—	—
決済	—	△13,451	—	—	△13,451
レベル3の時価への振替(※1、※4)	8,117	△1,110	—	—	7,006
レベル3の時価からの振替(※1、※5)	△15,152	△14,245	—	△507	△29,905
評価差額金の変動	—	—	—	1,404	1,404
期末残高	8,802	27,116	232	30,843	66,994
当連結会計年度の損益に計上した額のうち連結貸借対照表日において保有する金融商品の評価損益(※3)	31	△27,165	—	—	△27,134

※1 レベル間の振替は期首時点で認識することとしております。

※2 「商品有価証券等(資産)」、「デリバティブ取引(純額)」に係る損益は、「トレーディング損益」に含まれております。

※3 レベル3金融商品に関しては、観察可能でないインプットのみでなく、観察可能なインプットの変動も評価損益の一因となります。また、レベル3金融商品の多くは、他のレベル(レベル1、2)に分類されている金融商品によって経済的にヘッジされておりますが、当該金融商品の損益については上記の表には含まれておりません。

※4 レベル1もしくはレベル2からレベル3への振替の理由は、一部の有価証券について相場価格が入手不能となったため、または、評価技法へのインプットが観察可能でなくなったためであります。

※5 レベル3からレベル1もしくはレベル2への振替の理由は、一部の有価証券について相場価格が入手可能となったため、または、評価技法へのインプットが観察可能となったためであります。

(3) 時価の評価プロセスの説明

当社グループでは、各社のトレーディングを行う部署が保有する金融商品の時価について、当社が定める基本方針に従って算定及び検証が行われます。算定された結果は、算定に用いたインプットも含めて、トレーディングを行う部署から独立した部署によって検証が行われます。時価の算定に係るこれらのプロセスの結果は、各社により当社に報告され統制が行われています。

当社グループでは、時価の算定に用いる価格算定モデルについて承認を行うプロセスに関する指針を定めており、これに従って、価格算定モデルの開発部署から独立した部署がモデル内の仮定及び技法について検証を行います。また、価格算定モデルは観察可能な市場情報や代替可能なモデルとの比較分析等により、市場動向に合わせて調整する体制を構築しています。

(4)重要な観察できないインプットを変化させた場合の時価に対する影響に関する説明

重要な観察できないインプットとしては、長期のスワップ・レート、長期の通貨ベースス、長期の株価ボラティリティ、長期のクレジット・スプレッド及び相関係数があります。時価の算定において、金利の変動は期待キャッシュ・フローや割引率に影響し、クレジット・スプレッドの変動は倒産確率に影響します。ボラティリティについては、ボラティリティが上昇(下落)するとオプション価値が増加(減少)します。相関係数は複数資産間の幅広い組み合わせがあり、水準や変動の方向性もその組み合わせにより大きく異なる可能性があります。

債券(転換社債含む)の時価はクレジット・スプレッド、株価ボラティリティ等のインプットから算定され、市場が変動した場合には、インプットの影響額の合算として時価が増加もしくは減少します。

店頭デリバティブ取引の時価は年限毎や通貨毎に与えられる複数のインプットから算定され、市場が変動した場合には、全てのインプットの影響額の合算として時価が増加もしくは減少します。また、各インプット変動の時価への影響は取引毎の商品性によって決まります。レベル3に分類される金融商品の時価の算定に使用する観察可能でないインプットは、各々が必ずしも独立したものではなく、他のインプットとの相関関係が存在する場合があります。こうした関係の多くは、相関係数を通じて捕捉されており、複数資産間の幅広い相関係数の影響により、金融商品の時価が増加または減少します。

商品区分ごとに合理的に起こり得る代替的な仮定を用いた場合のレベル3金融商品の時価に対する影響は以下のとおりであり、前記(1)の重要な観察できないインプットの範囲を元に計算しています。

(単位：百万円)

	時価	プラスの時価変動	マイナスの時価変動
デリバティブ	27,116	1,443	1,443
その他有価証券	30,843	1,131	379

(注)3 当連結会計年度において、市場価格のない株式等(非上場株式等)並びに組合出資金等については次のとおりであり、資産(2)「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 ※1	114,787
その他有価証券	
非上場株式 ※1	34,316
組合出資金等 ※2	111,199

※1 非上場株式については、市場価格がないことから「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日)第5項に基づき、時価開示の対象とはしておりません。

※2 組合出資金等については、時価算定適用指針第27項に基づき、時価開示の対象とはしておりません。

2020年3月期

2021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、東京都その他の地域において、賃貸住宅等及び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、期中増減額及び時価は、次のとおりであります。

(単位：百万円)

		当連結 会計年度
連結貸借対照表 計上額	期首残高	—
	期中増減額	116,601
	期末残高	116,601
期末時価		117,580

- (注) 1. 貸借対照表計上額は、取得価額から減価償却累計額を控除した金額です。
2. 期末の時価は、社外の不動産鑑定士による鑑定評価額又は調査価額を記載しております。
3. 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、上表には含めておりません。これら不動産の連結貸借対照表計上額は、37,755百万円であります。

1. 賃貸等不動産の状況に関する事項

当社グループは、東京都その他の地域において、賃貸住宅等及び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、期中増減額及び時価は、次のとおりであります。

(単位：百万円)

		当連結 会計年度
連結貸借対照表 計上額	期首残高	116,601
	期中増減額	456,910
	期末残高	573,512
期末時価		575,473

- (注) 1. 貸借対照表計上額は、取得価額から減価償却累計額を控除した金額です。
2. 期末の時価は、社外の不動産鑑定士による鑑定評価額又は調査価額を記載しております。
3. 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、上表には含めておりません。これら不動産の連結貸借対照表計上額は、43,854百万円であります。
4. 当連結会計年度における連結貸借対照表計上額の期中増減額のうち、447,912百万円は大和証券オフィス投資法人の連結子会社化に伴う増加であります。

1株当たり情報に関する注記

1株当たり純資産額	796円33銭
1株当たり当期純利益	39円11銭

1株当たり純資産額	875円12銭
1株当たり当期純利益	71円20銭

その他の注記

該当事項はありません。

1. 減損損失に関する注記

当連結会計年度において、当社グループは以下の資産グループについて減損損失を計上しております。

	用途	地域	減損損失 (百万円)
継続使用資産	低収益性資産	アメリカ、アジア・オセアニア	696
処分予定資産	低稼働資産	東北、関東、中部、近畿、中国、四国、九州	8,698
合計			9,394

資産のグルーピングは、管理会計上の区分に従い行っております。また、処分予定資産については、個別物件単位で行っております。

処分の意思決定を行ったこと及び収益性が著しく低下したことに伴い、帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しております。

金額の内訳は、継続使用資産696百万円(うち、建物380百万円、のれん316百万円)、処分予定資産8,698百万円(うち、土地6,027百万円、建物2,183百万円、その他の無形固定資産351百万円、借地権135百万円)であります。

継続使用資産のうち、建物の回収可能価額は使用価値により、のれんの回収可能価額は再評価した企業価値により測定しております。

また、処分予定資産の回収可能価額は正味売却価額により測定しており、鑑定評価額等により評価しております。

2. 企業結合に関する注記

(1) 企業結合の概要

① 被取得企業の名称及びその事業の内容

被取得企業の名称 大和証券オフィス投資法人
事業の内容 特定資産に対する投資運用

② 企業結合を行った主な理由

当社グループの関連会社である大和証券オフィス投資法人(以下、「本投資法人」という。)は、本投資法人の自己投資口取得により、当社グループの議決権の所有割合が40%以上となり、実質支配力基準に鑑み、連結子会社となりました。連結子会社化により、当社グループと本投資法人の利害関係の一致を図るいわゆるセიმポート性をこれまで以上に高めることが可能となりました。当社グループは本投資法人の投資口価値の向上に積極的に関わり、これを実現することで、当社グループの企業価値向上にも資すると判断しております。

③ 企業結合日

2021年3月8日(みなし取得日 2021年2月28日)

④ 企業結合の法的形式

本投資法人による自己投資口の取得

⑤ 結合後企業の名称

変更ありません。

⑥ 取得した議決権比率

企業結合直前に所有していた議決権比率 39.89%
企業結合日に追加取得した議決権比率 0.12%
取得後の議決権比率 40.02%

⑦ 取得企業を決定するに至った主な根拠

当社グループの議決権の所有割合が40%以上となり、実質支配力基準に鑑み、支配が認められるため。

(2) 連結計算書類に含まれている被取得企業の業績の期間

2021年2月28日をみなし取得日としているため、それ以前の期間の業績については持分法による投資利益に反映されております。

(3) 被取得企業の取得原価及び対価の種類ごとの内訳

企業結合直前に保有していた本投資法人の投資口の時価	142,852百万円
企業結合日に追加取得した本投資法人の投資口の時価	—
被取得企業の取得原価	142,852百万円

(4) 被取得企業の取得原価と取得するに至った取引ごとの取得原価の合計額との差額

段階取得に係る差益 46,962百万円

(5) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

① 発生したのれん

8,987百万円

② 発生原因

今後の事業展開によって期待される将来の超過収益力から発生したものであります。

③ 償却方法及び償却期間

20年間にわたる均等償却

(6) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

(単位：百万円)

流動資産	31,060
固定資産	571,705
資産合計	602,765
流動負債	31,698
固定負債	236,587
負債合計	268,286

(7) 企業結合が当連結会計年度の開始の日に完了したと仮定した場合の当連結会計年度の連結損益計算書に及ぼす影響の概算額及びその算定方法

(単位：百万円)

営業収益	30,161
純営業収益	18,979
経常利益	8,943
親会社株主に帰属する当期純利益	46

2020年3月期

2021年3月期

(概算額の算定方法)

企業結合が連結会計年度開始の日に完了したと仮定し、持分法投資損益等の調整を加えて算定された営業収益、純営業収益及び損益情報と、取得企業の連結損益計算書における営業収益、純営業収益及び損益情報との差額を、影響の概算額としております。

なお、当該注記は監査証明を受けておりません。

重要な後発事象

該当事項はありません。

(自己株式の取得)

当社は、2021年4月28日開催の取締役会において、会社法第459条第1項の規定による定款の定めに基づき、自己株式の取得に係る事項について決議いたしました。

(1) 自己株式の取得を行う理由

昨今の株式市場の動向を踏まえ、資本効率の向上を通じて株主への利益還元を図るため、自己株式の取得をするものであります。

(2) 取得に係る事項の内容

① 取得する株式の種類

当社普通株式

② 取得する株式の総数

4,500万株 (上限)

(発行済株式総数(自己株式を除く)に対する割合2.95%)

③ 株式の取得価額の総額

300億円 (上限)

④ 期間

2021年5月19日から2022年3月24日まで

(但し、各四半期末日の最終5営業日及び各四半期決算発表日の翌営業日より10営業日の間は取得を行わない。)

⑤ 取得方法

信託方式による市場買付

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	短期借入金	121,766百万円
	長期借入金	150,000百万円
株式会社みずほ銀行	短期借入金	73,166百万円
	長期借入金	82,000百万円
株式会社三菱UFJ銀行	短期借入金	9,359百万円
	長期借入金	71,883百万円
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	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。

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	172,142百万円
株式会社みずほ銀行	長期借入金	102,000百万円
株式会社三菱UFJ銀行	短期借入金	11,071百万円
	長期借入金	81,000百万円
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	8,928百万円
	長期借入金	13,000百万円

(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。

2020年3月期

2021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)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	125,227	126,226	999
国債・地方債等	—	—	—
社債	125,227	126,226	999
その他	—	—	—
時価が連結貸借対照表計上額 を超えないもの	16,469	16,325	△143
国債・地方債等	—	—	—
社債	16,469	16,325	△143
その他	—	—	—

(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	516,254	459,384	56,870
株券	62,809	35,331	27,477
債券	372,146	354,329	17,816
国債・地方債等	95,715	92,253	3,461
社債	64,254	62,233	2,020
その他	212,176	199,842	12,334
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	81,299	69,723	11,576
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	394,141	412,560	△18,418
株券	49,905	60,386	△10,480
債券	212,602	215,835	△3,233
国債・地方債等	112,286	114,826	△2,539
社債	22,731	22,817	△85
その他	77,584	78,191	△607
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	39,848	39,848	—
その他	91,785	96,489	△4,704

(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39,147百万円含まれております。

(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	115,820	116,390	569
国債・地方債等	—	—	—
社債	115,820	116,390	569
その他	—	—	—
時価が連結貸借対照表計上額 を超えないもの	39,563	39,326	△236
国債・地方債等	—	—	—
社債	39,563	39,326	△236
その他	—	—	—

(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	587,935	517,567	70,368
株券	112,737	63,307	49,429
債券	375,152	364,092	11,059
国債・地方債等	94,064	92,119	1,944
社債	73,248	71,297	1,950
その他	207,840	200,675	7,164
その他	100,045	90,167	9,878
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	433,888	450,522	△16,634
株券	24,862	29,716	△4,854
債券	358,347	366,941	△8,594
国債・地方債等	122,137	127,136	△4,999
社債	132,866	132,970	△103
その他	103,342	106,834	△3,492
その他	50,677	53,863	△3,185

(注)市場価格のない株式等(非上場株式等)及び組合出資金等については、上表には含めておりません。(金融商品関係)2.金融商品の時価等及びレベルごとの内訳等に関する事項(注)4に記載のとおりであります。)

2020年3月期

2021年3月期

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

契約額また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)

原資産区分	種類	契約額等	時価	評価損益
金利関連取引	スワップ取引	10,439	△326	△326
通貨関連取引	スワップ取引	91,108	517	517
通貨関連取引	為替予約取引	171,063	△4,325	△4,325
クレジット・その他	クレジット・デリバティブ取引	40,000	60	60

(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、契約額また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)

原資産区分	種類	ヘッジ会計の方法	主なヘッジ対象	契約額等	時価
金利関連取引	スワップ取引	原則的処理方法	借入金及び有価証券	408,340	△24,733
通貨関連取引	スワップ取引	原則的処理方法 (注)	外貨建ての貸出金、有価証券	145,304	△779
通貨関連取引	為替予約取引	原則的処理方法 (注)	外貨建ての貸出金、有価証券、預金	370,340	3,415

(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

契約額また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)

原資産区分	種類	契約額等	時価	評価損益
通貨関連取引	スワップ取引	83,072	△1,087	△1,087
通貨関連取引	為替予約取引	196,915	△1,034	△1,034

(注) 時価の算定方法については、「(金融商品関係) 2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項 (注) 1 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明 (1) 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、契約額また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)

原資産区分	種類	ヘッジ会計の方法	主なヘッジ対象	契約額等	時価
金利関連取引	スワップ取引	原則的処理方法	借入金及び有価証券	482,502	△8,833
通貨関連取引	スワップ取引	原則的処理方法 (注)	外貨建ての貸出金、有価証券	35,306	△1,056
通貨関連取引	為替予約取引	原則的処理方法 (注)	外貨建ての貸出金、有価証券、預金	274,938	△700

(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。

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		2021年3月末	2020年12月末	2020年9月末	2020年6月末	2020年3月末
資本						
1	普通株式等Tier1資本の額	1,123,656	1,079,983	1,034,222	1,043,809	1,035,250
2	Tier1資本の額	1,305,210	1,214,038	1,162,574	1,179,907	1,171,864
3	総自己資本の額	1,305,210	1,214,038	1,162,574	1,179,907	1,171,864
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	6,008,356	5,160,906	5,174,911	5,406,413	5,536,310
自己資本比率						
5	連結普通株式等Tier1比率	18.70%	20.92%	19.98%	19.30%	18.69%
6	連結Tier1比率	21.72%	23.52%	22.46%	21.82%	21.16%
7	連結総自己資本比率	21.72%	23.52%	22.46%	21.82%	21.16%
資本バッファ						
8	資本保全バッファ比率	2.50%	2.50%	2.50%	2.50%	2.50%
9	カウンター・シクリカル・バッファ比率	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
10	G-SIB/D-SIBバッファ比率	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%	0.50%
11	最低連結資本バッファ比率	3.00%	3.00%	3.00%	3.00%	3.00%
12	連結資本バッファ比率	13.72%	15.52%	14.46%	13.82%	13.16%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの額	18,916,695	18,282,142	18,436,197	18,136,475	20,200,161
14	連結レバレッジ比率	6.89%	6.64%	6.30%	6.50%	5.80%

2020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	1,189,921	
1a	うち、資本金及び資本剰余金の額	478,206	(i), (j)
2	うち、利益剰余金の額	835,727	(k)
1c	うち、自己株式の額(△)	110,337	(l), (m)
26	うち、社外流出予定額(△)	13,675	
	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	8,901	(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	7,742	(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)	1,206,565	
普通株式等Tier1資本に係る調整項目 (2)			
8+9	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものを除く。)の額の合計額	159,170	
8	うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	36,261	(e), (g)
9	うち、のれん及びモーゲージ・サービシング・ライツに係るもの以外のものの額	122,908	(f)
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	569	(d), (h)
11	繰延ヘッジ損益の額	2,012	(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	535	
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	67	(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	8,958	(a), (b), (c), (g)
19+20+21	特定項目に係る十パーセント基準超過額	—	
19	うち、その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に該当するものに関連するものの額	—	
20	うち、無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に関連するものの額	—	
21	うち、繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に関連するものの額	—	
22	特定項目に係る十五パーセント基準超過額	—	
23	うち、その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に該当するものに関連するものの額	—	
24	うち、無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に関連するものの額	—	
25	うち、繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に関連するものの額	—	
27	その他Tier1資本不足額	—	
28	普通株式等Tier1資本に係る調整項目の額 (ロ)	171,315	
普通株式等Tier1資本			
29	普通株式等Tier1資本の額((イ)-(ロ)) (ハ)	1,035,250	
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	138,800	
	特別目的会社等の発行するその他Tier1資本調達手段の額	—	
34-35	その他Tier1資本に係る調整後非支配株主持分等の額	6,576	(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)	145,376	

2021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	1,244,539	
1a	うち、資本金及び資本剰余金の額	478,048	(i), (j)
2	うち、利益剰余金の額	912,223	(k)
1c	うち、自己株式の額(△)	107,636	(l), (m)
26	うち、社外流出予定額(△)	38,096	
	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	9,125	(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	51,453	(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)	1,305,118	
普通株式等Tier1資本に係る調整項目 (2)			
8+9	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものを除く。)の額の合計額	164,084	
8	うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	56,411	(e), (g)
9	うち、のれん及びモーゲージ・サービシング・ライツに係るもの以外のものの額	107,672	(f)
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	348	(d), (h)
11	繰延ヘッジ損益の額	△1,556	(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	329	
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	31	(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	18,223	(a), (b), (c), (g)
19+20+21	特定項目に係る十パーセント基準超過額	—	
19	うち、その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に該当するものに関連するものの額	—	
20	うち、無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に関連するものの額	—	
21	うち、繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に関連するものの額	—	
22	特定項目に係る十五パーセント基準超過額	—	
23	うち、その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に該当するものに関連するものの額	—	
24	うち、無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に関連するものの額	—	
25	うち、繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に関連するものの額	—	
27	その他Tier1資本不足額	—	
28	普通株式等Tier1資本に係る調整項目の額 (ロ)	181,462	
普通株式等Tier1資本			
29	普通株式等Tier1資本の額((イ)-(ロ)) (ハ)	1,123,656	
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	149,100	
	特別目的会社等の発行するその他Tier1資本調達手段の額	—	
34-35	その他Tier1資本に係る調整後非支配株主持分等の額	47,388	(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)	196,488	

2020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	3,006	(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	5,756	
43	その他Tier1資本に係る調整項目の額 (ホ)	8,762	
その他Tier1資本			
44	その他Tier1資本の額((二) - (ホ)) (ヘ)	136,613	
Tier1資本			
45	Tier1資本の額((ハ) + (ヘ)) (ト)	1,171,864	
Tier2資本に係る基礎項目 (4)			
46	Tier2資本調達手段に係る株主資本の額及びその内訳	—	
	Tier2資本調達手段に係る新株予約権の額	—	
	Tier2資本調達手段に係る負債の額	—	
	特別目的会社等の発行するTier2資本調達手段の額	—	
48 - 49	Tier2資本に係る調整後非支配株主持分等の額	1,547	(q)
47 + 49	適格旧Tier2資本調達手段の額のうちTier2資本に係る基礎項目の額に含まれる額	—	
47	うち、最終指定親会社及び最終指定親会社の特別目的会社等の発行する資本調達手段の額	—	
49	うち、最終指定親会社の連結子法人等(最終指定親会社の特別目的会社等を除く。)の発行する資本調達手段の額	—	
50	一般貸倒引当金Tier2算入額及び適格引当金Tier2算入額の合計額	—	
50a	うち、一般貸倒引当金Tier2算入額	—	
50b	うち、適格引当金Tier2算入額	—	
51	Tier2資本に係る基礎項目の額 (チ)	1,547	
Tier2資本に係る調整項目			
52	自己保有Tier2資本調達手段の額	—	
53	意図的に保有している他の金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額	—	
54	少数出資金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額	7,303	(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に該当しなかったものの額	—	
55	その他金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額	—	
57	Tier2資本に係る調整項目の額 (リ)	7,303	
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)	1,171,864	
リスク・アセット (5)			
60	リスク・アセットの額の合計額 (ヲ)	5,536,310	
連結自己資本規制比率			
61	連結普通株式等Tier1比率((ハ) / (ヲ))	18.69%	
62	連結Tier1比率((ト) / (ヲ))	21.16%	
63	連結総自己資本規制比率((ル) / (ヲ))	21.16%	
64	最低連結資本バッファ率	3.00%	
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	0.00%	
67	うち、G-SIB / D-SIB / バッファ率	0.50%	
68	連結資本バッファ率	13.16%	
調整項目に係る参考事項 (6)			
72	少数出資金融機関等の対象資本等調達手段に係る調整項目不算入額	104,420	(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	62,626	(a), (b), (c), (g)
74	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に係る調整項目不算入額	—	
75	繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に係る調整項目不算入額	16,563	(d), (h)

2021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	5,411	(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	9,522	
43	その他Tier1資本に係る調整項目の額 (ホ)	14,934	
その他Tier1資本			
44	その他Tier1資本の額((二) - (ホ)) (ヘ)	181,554	
Tier1資本			
45	Tier1資本の額((ハ) + (ヘ)) (ト)	1,305,210	
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	11,150	(q)
47 + 49	適格旧Tier2資本調達手段の額のうちTier2資本に係る基礎項目の額に含まれる額	—	
47	うち、最終指定親会社及び最終指定親会社の特別目的会社等の発行する資本調達手段の額	—	
49	うち、最終指定親会社の連結子法人等(最終指定親会社の特別目的会社等を除く。)の発行する資本調達手段の額	—	
50	一般貸倒引当金Tier2算入額及び適格引当金Tier2算入額の合計額	—	
50a	うち、一般貸倒引当金Tier2算入額	—	
50b	うち、適格引当金Tier2算入額	—	
51	Tier2資本に係る基礎項目の額 (チ)	11,150	
Tier2資本に係る調整項目			
52	自己保有Tier2資本調達手段の額	—	
53	意図的に保有している他の金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額	—	
54	少数出資金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額	20,673	(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に該当しなかったものの額	—	
55	その他金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額	—	
57	Tier2資本に係る調整項目の額 (リ)	20,673	
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)	1,305,210	
リスク・アセット (5)			
60	リスク・アセットの額の合計額 (ヲ)	6,008,356	
連結自己資本規制比率			
61	連結普通株式等Tier1比率((ハ) / (ヲ))	18.70%	
62	連結Tier1比率((ト) / (ヲ))	21.72%	
63	連結総自己資本規制比率((ル) / (ヲ))	21.72%	
64	最低連結資本バッファ率	3.00%	
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	0.00%	
67	うち、G-SIB / D-SIB / バッファ率	0.50%	
68	連結資本バッファ率	13.72%	
調整項目に係る参考事項 (6)			
72	少数出資金融機関等の対象資本等調達手段に係る調整項目不算入額	114,187	(a), (b), (c), (g)
73	その他金融機関等に係る対象資本等調達手段のうち普通株式に係る調整項目不算入額	68,331	(a), (b), (c), (g)
74	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に係る調整項目不算入額	—	
75	繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に係る調整項目不算入額	11,053	(d), (h)

2020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 (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。)	-	

2021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 (7)			
76	一般貸倒引当金の額	-	
77	一般貸倒引当金に係るTier2資本算入上限額	-	
78	内部格付手法採用最終指定親会社において、適格引当金の合計額から事業法人等向けエクスポージャー及びリテール向けエクスポージャーの期待損失額の合計額を控除した額 (当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-	
79	適格引当金に係るTier2資本算入上限額	-	
資本調達手段に係る経過措置に関する事項 (8)			
82	適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額	-	
83	適格旧Tier1資本調達手段の額から適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額を控除した額 (当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-	
84	適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額	-	
85	適格旧Tier2資本調達手段の額から適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額を控除した額 (当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-	

定性的な開示事項

1. 連結の範囲に関する事項

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

会社グループに属する会社は、会計連結範囲に含まれる会社に加え、銀行法施行規則に規定される業務を営む会社を含めているため、会計連結範囲に含まれる会社よりも連結の範囲は広範となっています。

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

連結子会社の数	66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(注)	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PIパートナーズ株式会社	投資業
大和エナジー・インフラ株式会社	投資業
大和リアル・エステート・アセット・マネジメント株式会社	投資運用業、投資助言・代理業
サムティ・レジデンシャル投資法人	特定資産に対する投資運用
大和証券キャピタル・マーケット ヨーロッパリミテッド	有価証券関連業
大和証券キャピタル・マーケット 香港リミテッド	有価証券関連業
大和証券キャピタル・マーケット シンガポールリミテッド	有価証券関連業
大和証券キャピタル・マーケット アメリカホールディングスInc.	子会社の統合・管理
大和証券キャピタル・マーケット アメリカInc.	有価証券関連業

(注) 大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日に大和アセットマネジメント株式会社に商号変更しております。

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。

定性的な開示事項

1. 連結の範囲に関する事項

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

会社グループに属する会社は、会計連結範囲に含まれる会社に加え、銀行法施行規則に規定される業務を営む会社を含めているため、会計連結範囲に含まれる会社よりも連結の範囲は広範となっています。

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

連結子会社の数	118社
主要な連結子会社の名称	主要な業務の内容
大和証券株式会社	有価証券関連業、投資助言・代理業
大和アセットマネジメント株式会社	投資運用業、投資助言・代理業
株式会社大和総研ホールディングス(注)	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
大和証券ファシリティーズ株式会社	不動産賃貸業・管理業
株式会社大和ネクスト銀行	銀行業
株式会社大和総研(注)	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(注)	情報サービス業
大和企業投資株式会社	投資業
大和PIパートナーズ株式会社	投資業
大和エナジー・インフラ株式会社	投資業
大和リアル・エステート・アセット・マネジメント株式会社	投資運用業、投資助言・代理業
大和証券オフィス投資法人	特定資産に対する投資運用
サムティ・レジデンシャル投資法人	特定資産に対する投資運用
大和証券キャピタル・マーケット ヨーロッパリミテッド	有価証券関連業
大和証券キャピタル・マーケット 香港リミテッド	有価証券関連業
大和証券キャピタル・マーケット シンガポールリミテッド	有価証券関連業
大和証券キャピタル・マーケット アメリカホールディングスInc.	子会社の統合・管理
大和証券キャピタル・マーケット アメリカInc.	有価証券関連業

(注) 株式会社大和総研ホールディングス、株式会社大和総研及び株式会社大和総研ビジネス・イノベーションの3社は、2021年4月1日付で株式会社大和総研ホールディングスを吸収合併存続会社、株式会社大和総研及び株式会社大和総研ビジネス・イノベーションを吸収合併消滅会社とする吸収合併を行い、商号を株式会社大和総研といたしました。

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。

2020年3月末

ニ 会社グループに属する会社であって会計連結範囲に含まれないもの及び会社グループに属しない会社であって会計連結範囲に含まれるものの名称、貸借対照表の総資産の額及び純資産の額並びに主要な業務の内容

会社グループに属する会社であって会計連結範囲に含まれないものは、以下の通りです。

(単位 百万円)

会社グループに属する会社の名称	主要な業務の内容	総資産の額	純資産の額
大和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	1,964	1,955
株式会社のぞみフィナン シャルホールディングス	持株会社	1,327	1,212
のぞみ債権回収株式会社	債権管理回収業	1,905	714
大和インベスター・リレー ションズ株式会社	企業のIR(投資家向け広報)活動に関するコンサルティング等の支援業務	784	557
DMS Ltd.	システムソリューション、リサーチ、コンサルティング	534	439
Asian Energy Investments Pte., Ltd.	投資運用業、投資助言・代理業	496	430
大和ACAヘルスケア株式会社	投資ファンドの運営、アセットマネジメント、不動産関連事業	255	223
大和ファシリティ・サービス株式会社	不動産賃貸業・管理業	200	200
DS Capital International (NI) Ltd.	投資業	104	104
のぞみファイナンス&コンサルティング株式会社	貸金業務及びコンサルティング業務	6,351	83
Daiwa Corporate Investment Asia Ltd.	投資業	136	75
湖北高和創業投資管理有限公司	投資運用業、投資助言・代理業	52	42
NIFコーポレート・インベストメンツ株式会社	投資業	11	11

(注)大和ファシリティ・サービス株式会社は、2020年7月1日に大和証券ファシリティーズ株式会社に商号変更しております。

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

ホ 会社グループ内の資金及び自己資本の移動に係る制限等の概要

グループ内の資金及び自己資本の移動に係る特別な制限等はありません。

2. 自己資本の充実度に関する評価方法の概要

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

(経済資本)

当社グループでは、リスクアパタイト・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うる資本バッファ等を考慮の上、主要なグループ会社等に対し経済資本を配賦しております。経済資本配賦の際には、グループ会社等の過去の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。

2021年3月末

ニ 会社グループに属する会社であって会計連結範囲に含まれないもの及び会社グループに属しない会社であって会計連結範囲に含まれるものの名称、貸借対照表の総資産の額及び純資産の額並びに主要な業務の内容

会社グループに属する会社であって会計連結範囲に含まれないものは、以下の通りです。

(単位 百万円)

会社グループに属する会社の名称	主要な業務の内容	総資産の額	純資産の額
大和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	1,929	1,919
大和インベスター・リレー ションズ株式会社	企業のIR(投資家向け広報)活動に関するコンサルティング等の支援業務	674	436
DMS Ltd.	システムソリューション、リサーチ、コンサルティング	248	211
Asian Energy Investments Pte., Ltd.	投資運用業、投資助言・代理業	554	502
大和ACAヘルスケア株式会社	投資ファンドの運営、アセットマネジメント、不動産関連事業	316	257
DS Capital International (NI) Ltd.	投資業	0	0
Daiwa Corporate Investment Asia Ltd.	投資業	107	74
湖北高和創業投資管理有限公司	投資運用業、投資助言・代理業	45	43

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

ホ 会社グループ内の資金及び自己資本の移動に係る制限等の概要

グループ内の資金及び自己資本の移動に係る特別な制限等はありません。

2. 自己資本の充実度に関する評価方法の概要

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

(経済資本)

当社グループでは、リスクアパタイト・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うる資本バッファ等を考慮の上、主要なグループ会社等に対し経済資本を配賦しております。経済資本配賦の際には、グループ会社等の過去の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、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おります。ストレス・テストにあたっては、専門家・関連部署等による議論を交えながら、内外の環境を分析し、複数のシナリオを策定します。

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

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

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>

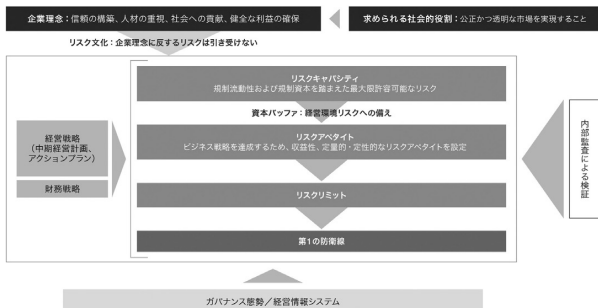
リスクアペタイト・フレームワークとは、収益目標や事業計画達成のために進んで受け入れるリスクの種類と総量(リスクアペタイト)を明確にし、当社グループ全体のリスクをコントロールする枠組みです。

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。

(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おります。ストレス・テストにあたっては、専門家・関連部署等による議論を交えながら、内外の環境を分析し、複数のシナリオを策定します。

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

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

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>

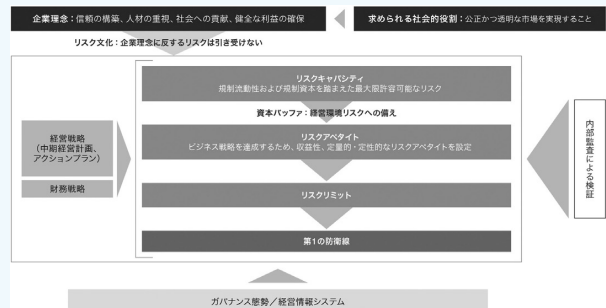
リスクアペタイト・フレームワークとは、収益目標や事業計画達成のために進んで受け入れるリスクの種類と総量(リスクアペタイト)を明確にし、当社グループ全体のリスクをコントロールする枠組みです。

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。

2020年3月末

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。

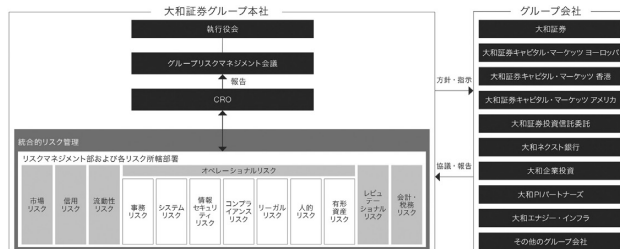
ビジネス戦略や資本配賦計画等が見直される場合、又は外部環境の著しい変化やリスクプロファイルが当初想定していた水準を大きく上回る可能性が生じた場合には、必要に応じて見直しを行なっております。

<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います。

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

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



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

2021年3月末

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います。

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

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



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

2020年3月末

(リスク管理の基本方針)

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

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

(リスクの定義)

(1) 市場リスク

金利、外国為替レート、株価などの市場で取引される商品の価格やレートが変化することによって、保有する金融商品又は金融取引により損失を被るリスク及び市場の流動性の著しい低下により市場における取引が成立せず、又は著しく不利な条件での取引を余儀なくされることにより、損失を被るリスクをいいます。

(2) 信用リスク

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

(3) 流動性リスク

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

(4) オペレーショナル・リスク

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

(5) 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。

(注) 2020年3月期末以降、投資に係るリスク等を管理する執行役及び所管部署を設置の上、リスク管理態勢の整備に努めています。

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	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

2021年3月末

(リスク管理の基本方針)

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

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

(リスクの定義)

(1) 市場リスク

金利、外国為替レート、株価などの市場で取引される商品の価格やレートが変化することによって、保有する金融商品又は金融取引により損失を被るリスク及び市場の流動性の著しい低下により市場における取引が成立せず、又は著しく不利な条件での取引を余儀なくされることにより、損失を被るリスクをいいます。

(2) 信用リスク

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

(3) 流動性リスク

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

(4) オペレーショナル・リスク

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

(5) モデルリスク

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

(6) 投資リスク

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

(7) レピュテーション・リスク

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

(8) 会計・税務リスク

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

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

リスク・カテゴリ	執行役	所管部署	会議体
市場リスク	CRO	リスクマネジメント部	グループリスクマネジメント会議
信用リスク	CRO	リスクマネジメント部	グループリスクマネジメント会議
流動性リスク	CRO	リスクマネジメント部	グループリスクマネジメント会議
オペレーショナル・リスク	CRO	リスクマネジメント部	グループリスクマネジメント会議
モデルリスク	CRO	リスクマネジメント部	グループリスクマネジメント会議
投資リスク	CRO	リスクマネジメント部	グループリスクマネジメント会議
レピュテーション・リスク	広報担当執行役 IR室を管轄する執行役 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

2020年3月末

(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、当社グループが取引先グループに対して許容できる与信相当額の設定し、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号令和2年3月17日）に規定する正常先債権に相当する債権については、一定の種類毎に分類し、予想損失率等に基づき計上しております。すべての債権は、資産の自己査定基準に基づき、営業関連部署及び審査所管部署が資産査定を実施しております。

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

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

株式会社格付投資情報センター
株式会社日本格付研究所
ムーディーズ・インベスターズ・サービス・インク
SPグローバル・レーティング

2021年3月末

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

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

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

ロ 会計上の引当て及び償却に関する基準の概要

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

また銀行子会社においては、「銀行等金融機関の資産の自己査定並びに貸倒償却及び貸倒引当金の監査に関する実務指針」（日本公認会計士協会銀行等監査特別委員会報告第4号2020年10月8日）に規定する正常先債権に相当する債権については、一定の種類毎に分類し、予想損失率等に基づき計上しております。すべての債権は、資産の自己査定基準に基づき、営業関連部署及び審査所管部署が資産査定を実施しております。

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

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

株式会社格付投資情報センター
株式会社日本格付研究所
ムーディーズ・インベスターズ・サービス・インク
S&Pグローバル・レーティング

2020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ボ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 ネットティングを利用する方針及びプロセスの基本的な特徴並びにネットティングの利用状況に係る説明

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

ロ 担保評価・担保管理の方針・プロセスの基本的な特徴

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

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

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

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

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

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

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

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ボ取引では、原則として相対ネットティング契約（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ティング契約については信用リスク削減手法を適用しております。信用リスク削減手法については「包括的手法」を採用しております。

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

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

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、シミュレーションで計算した将来の期待エクスポージャーと市場で観測されるCDSスプレッドに基づき引当金を計算しています。

2021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ボ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 ネットティングを利用する方針及びプロセスの基本的な特徴並びにネットティングの利用状況に係る説明

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

ロ 担保評価・担保管理の方針・プロセスの基本的な特徴

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

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

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

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

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

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

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

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

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

派生商品取引及びレボ取引では、原則として相対ネットティング契約（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ティング契約については信用リスク削減手法を適用しております。信用リスク削減手法については「包括的手法」を採用しております。

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

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

7. 証券化取引に係るリスクに関する事項

イ リスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要

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

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

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

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

該当ありません。

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

該当ありません。

ホ 証券化取引に関する会計方針

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

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

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

株式会社格付投資情報センター
株式会社日本格付研究所
ムーディーズ・インベスターズ・サービス・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。

7. 証券化取引に係るリスクに関する事項

イ リスクの特性並びにリスク管理の方針、手続及び体制の概要

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

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

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

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

該当ありません。

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

該当ありません。

ホ 証券化取引に関する会計方針

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

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

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

株式会社格付投資情報センター
株式会社日本格付研究所
ムーディーズ・インベスターズ・サービス・インク
S&P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、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・テストングを実施し、モデルの有効性を検証しております。
2020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8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。

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・テストングを実施し、モデルの有効性を検証しております。
2021年3月期の直近250営業日においては、信頼水準99%のVaRの超過は発生していません。
- ・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。

2020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に実施しており、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、銀行業務、取引関係上の目的等の投資有価証券等において、出資等又は株式等エクスポージャーを保有しています。各業務において特有のリスク特性があるため、それらに応じた市場リスク管理、信用リスク管理等の枠組みに基づきリスク量を計測する等適切な方法でリスク管理を行い、グループリスクマネジメント会議に報告しております。

ロ その他有価証券、子会社株式及び関連会社株式の区分ごとのリスク管理の方針

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

ハ 株式等エクスポージャーの評価等重要な会計方針

その他有価証券の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。

2021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に実施しており、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、銀行業務、取引関係上の目的等の投資有価証券等において、出資等又は株式等エクスポージャーを保有しています。各業務において特有のリスク特性があるため、それらに応じた市場リスク管理、信用リスク管理等の枠組みに基づきリスク量を計測する等適切な方法でリスク管理を行い、グループリスクマネジメント会議に報告しております。

ロ その他有価証券、子会社株式及び関連会社株式の区分ごとのリスク管理の方針

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

ハ 株式等エクスポージャーの評価等重要な会計方針

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

11. 金利リスクに関する事項

イ リスク管理の方針及び手続の概要

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

ロ 金利リスクの算定手法の概要

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

2020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)

CC2：連結貸借対照表の科目と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係			
項目	公表 連結貸借対照表	規制上の 連結範囲に基づく 連結貸借対照表	別紙様式第一号 (CC1)の参照項目
資産の部			
流動資産			
現金・預金	3,964,512	3,969,510	
預託金	415,953	415,953	
受取手形及び売掛金	18,427	18,427	
有価証券 (a)	873,064	873,064	8,18,39,54,72, 73
トレーディング商品 (b)	8,027,289	8,027,289	16,18,39,54,72, 73
約定見返勘定	—	—	
営業投資有価証券 (c)	202,557	202,557	18,39,54,72,73
投資損失引当金	△1,160	△1,160	
営業貸付金	1,768,471	1,768,471	
仕掛品	609	609	
信用取引資産	114,384	114,384	
有価証券担保貸付金	6,685,756	6,685,756	
立替金	25,682	25,682	
短期貸付金	3,087	3,087	
未収収益	36,483	36,594	
繰延税金資産 (d)	—	—	10,75
その他の流動資産	711,935	713,429	
貸倒引当金	△415	△415	
流動資産計	22,846,637	22,853,241	
固定資産			
有形固定資産	309,166	313,076	
無形固定資産	124,115	124,176	
のれん (e)	13,629	13,629	8
のれん以外 (f)	110,486	110,547	9
投資その他の資産	542,179	542,093	
投資有価証券 (g)	491,660	489,051	8,18,39,54,72, 73
繰延税金資産 (h)	17,125	17,133	10,75
上記以外	33,394	35,907	
固定資産計	975,462	979,347	
繰延資産計	—	—	
資産の部合計	23,822,099	23,832,588	
負債の部			
流動負債			
支払手形及び買掛金	8,938	8,938	
トレーディング商品	5,362,261	5,362,261	
約定見返勘定	544,689	544,689	
信用取引負債	59,256	59,256	
有価証券担保借入金	7,198,730	7,198,730	
銀行業における預金	4,037,201	4,037,201	
預り金	353,943	360,176	
受入保証金	414,641	414,641	
短期借入金	1,276,948	1,276,948	
コマーシャルペーパー	178,000	178,000	
1年内償還予定の社債	277,852	277,852	
未払法人税等	7,403	7,428	
繰延税金負債	—	3	
賞与引当金	26,747	26,747	
その他の流動負債	172,101	173,255	
固定負債			
社債	1,379,226	1,379,226	
長期借入金	1,183,272	1,183,613	
繰延税金負債	4,369	4,369	
退職給付に係る負債	44,359	44,359	
訴訟損失引当金	1,570	1,570	
負ののれん	—	—	
その他の固定負債	28,900	29,217	
特別法上の準備金	3,918	3,918	
負債の部合計	22,564,333	22,572,408	

2021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)

CC2：連結貸借対照表の科目と自己資本の構成に関する開示項目の対応関係			
項目	公表 連結貸借対照表	規制上の 連結範囲に基づく 連結貸借対照表	別紙様式第一号 (CC1)の参照項目
資産の部			
流動資産			
現金・預金	4,763,197	4,765,881	
預託金	485,876	485,876	
受取手形及び売掛金	21,488	21,488	
有価証券 (a)	996,683	996,683	8,18,39,54,72, 73
トレーディング商品 (b)	7,834,093	7,834,093	16,18,39,54,72, 73
約定見返勘定	—	—	
営業投資有価証券 (c)	97,092	97,092	18,39,54,72,73
投資損失引当金	△588	△588	
営業貸付金	1,996,121	1,996,121	
仕掛品	603	603	
信用取引資産	162,078	162,078	
有価証券担保貸付金	7,448,321	7,448,321	
立替金	20,131	20,131	
短期貸付金	595	595	
未収収益	36,229	36,229	
繰延税金資産 (d)	—	—	10,75
その他の流動資産	788,790	789,499	
貸倒引当金	△4,401	△4,401	
流動資産計	24,646,314	24,649,707	
固定資産			
有形固定資産	880,477	880,604	
無形固定資産	128,786	128,848	
のれん (e)	21,229	21,229	8
のれん以外 (f)	107,557	107,619	9
投資その他の資産	443,751	442,244	
投資有価証券 (g)	402,590	401,036	8,18,39,54,72, 73
繰延税金資産 (h)	11,397	11,402	10,75
上記以外	29,764	29,805	
固定資産計	1,453,016	1,451,698	
繰延資産計	—	—	
資産の部合計	26,099,330	26,101,405	
負債の部			
流動負債			
支払手形及び買掛金	5,382	5,382	
トレーディング商品	4,367,822	4,367,822	
約定見返勘定	1,320,279	1,320,279	
信用取引負債	64,022	64,022	
有価証券担保借入金	8,176,094	8,176,094	
銀行業における預金	4,416,097	4,416,097	
預り金	419,994	420,001	
受入保証金	366,351	366,351	
短期借入金	1,408,288	1,408,288	
コマーシャルペーパー	265,000	265,000	
1年内償還予定の社債	203,774	203,774	
未払法人税等	17,962	18,012	
繰延税金負債	—	—	
賞与引当金	36,316	36,316	
その他の流動負債	151,966	152,221	
固定負債			
社債	1,557,333	1,557,333	
長期借入金	1,586,913	1,586,913	
繰延税金負債	43,176	43,176	
退職給付に係る負債	44,773	44,773	
訴訟損失引当金	1,809	1,809	
負ののれん	—	—	
その他の固定負債	50,430	50,547	
特別法上の準備金	3,699	3,699	
負債の部合計	24,507,489	24,507,920	

2020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)	230,808	230,808	1a
利益剰余金 (k)	834,442	835,727	2
自己株式 (l)	△110,351	△110,351	1c
自己株式申込証拠金 (m)	13	13	1c
株主資本合計	1,202,310	1,203,595	
その他の包括利益累計額			
その他有価証券評価差額金	26,853	26,853	
繰延ヘッジ損益 (n)	△13,592	△13,592	11
為替換算調整勘定	△5,556	△5,517	
その他の包括利益累計額 (o)	7,703	7,742	3
新株予約権 (p)	8,901	8,901	1b
非支配株主持分 (q)	38,849	39,938	34－35,48－49
純資産の部合計	1,257,766	1,260,180	

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。

2021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)	230,651	230,651	1a
利益剰余金 (k)	911,742	912,130	2
自己株式 (l)	△107,646	△107,646	1c
自己株式申込証拠金 (m)	9	9	1c
株主資本合計	1,282,154	1,282,154	
その他の包括利益累計額			
その他有価証券評価差額金	41,587	41,587	
繰延ヘッジ損益 (n)	△3,058	△3,058	11
為替換算調整勘定	12,886	13,017	
その他の包括利益累計額 (o)	51,415	51,415	3
新株予約権 (p)	9,125	9,125	1b
非支配株主持分 (q)	249,145	250,268	34－35,48－49
純資産の部合計	1,591,841	1,593,484	

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。

2020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

【2020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	6,410,961	1,204,881	1,013,821	4,192,259
	海外	453,040	62,130	29,725	361,183
地域別合計		6,864,002	1,267,011	1,043,546	4,553,443
	ソブリン	5,047,755	960,387	682,224	3,405,143
	金融機関	511,820	—	9,634	502,185
	法人	433,406	289,912	24,669	118,823
	CCP	34,648	—	—	34,648
	その他	836,370	16,710	327,017	492,641
業種別合計		6,864,002	1,267,011	1,043,546	4,553,443
	1年以下	320,434	253,228	38,854	28,352
	1年超3年以下	78,800	1	78,773	25
	3年超5年以下	71,663	3	71,641	19
	5年超7年以下	86,167	—	86,133	33
	7年超	425,892	—	416,784	9,108
	期間の定めのないもの	5,881,043	1,013,778	351,359	4,515,904
残存期間別合計		6,864,002	1,267,011	1,043,546	4,553,443

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)

		2020年3月末		
		期末残高	引当金の額	償却額
	日本	5,022	1,441	—
	海外	2,527	354	—
地域別合計		7,550	1,795	—
	ソブリン	—	—	—
	金融機関	34	—	—
	法人	2,906	610	—
	その他	4,608	1,185	—
業種別合計		7,550	1,795	—

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	356	252	2	—
	海外	605	—	—	—
地域別合計		961	252	2	—
	ソブリン	—	—	—	—
	金融機関	34	—	—	—
	法人	925	252	2	—
	CCP	—	—	—	—
	その他	—	—	—	—
業種別合計		961	252	2	—

2021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

【2021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	8,536,949	1,403,234	1,140,836	5,992,878
	海外	517,751	68,365	31,216	418,169
地域別合計		9,054,700	1,471,599	1,172,052	6,411,047
	ソブリン	5,978,681	1,092,858	728,585	4,157,237
	金融機関	879,050	—	10,268	868,782
	法人	681,219	359,993	130,972	190,252
	CCP	30,140	—	—	30,140
	その他	1,485,608	18,746	302,226	1,164,634
業種別合計		9,054,700	1,471,599	1,172,052	6,411,047
	1年以下	496,777	312,372	152,408	31,997
	1年超3年以下	126,586	2	126,573	9
	3年超5年以下	58,470	—	58,418	52
	5年超7年以下	41,460	—	41,405	55
	7年超	470,943	—	460,065	10,877
	期間の定めのないもの	7,860,461	1,159,224	333,180	6,368,056
残存期間別合計		9,054,700	1,471,599	1,172,052	6,411,047

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)

		2021年3月末		
		期末残高	引当金の額	償却額
	日本	79,944	12,668	—
	海外	6,565	366	—
地域別合計		86,509	13,035	—
	ソブリン	—	—	—
	金融機関	35	—	—
	法人	74,012	5,006	—
	その他	12,461	8,028	—
業種別合計		86,509	13,035	—

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	30,862	124	36	—
	海外	74	—	—	—
地域別合計		30,937	124	36	—
	ソブリン	—	—	—	—
	金融機関	35	—	—	—
	法人	30,901	124	36	—
	CCP	—	—	—	—
	その他	—	—	—	—
業種別合計		30,937	124	36	—

2020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. リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーについて、エクスポージャーの区分ごとの額

(単位 百万円)

	エクスポージャーの額	
リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(リスク・スルー方式)	824,315	
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)	74,083	
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%)	115	
合計	898,515	

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	
		2020年3月末	2019年3月末	2020年3月末	2019年3月末
1	信用リスク	1,065,998	816,153	85,280	65,292
2	うち、標準的手法適用分	725,737	617,863	58,059	49,429
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	340,260	198,289	27,220	15,863
4	カウンターパーティ信用リスク	1,015,852	992,548	81,268	79,403
5	うち、SA-CCR適用分	427,491	331,892	34,199	26,551
6	うち、期待エクスポージャー 方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	347,795	345,076	27,823	27,606
	うち、中央清算機関関連工 クスポージャー	15,943	14,842	1,275	1,187
	その他	224,621	300,737	17,969	24,058
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(リスク・スルー方式)	516,553	336,045	41,324	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)	73,154	60,870	5,851	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%)	1,443	653	115	52
11	未決済取引	255	165	20	13
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	119,868	145,587	9,589	11,647
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	117,501	145,587	9,400	11,647
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—	—	—	—
	うち、1250%のリスク・ ウェイト適用分	2,367	—	189	—
16	マーケット・リスク	1,604,159	1,530,739	128,332	122,459
17	うち、標準的方式適用分	838,138	838,622	67,051	67,089
18	うち、内部モデル方式適用分	766,021	692,117	61,281	55,369
19	オペレーショナル・リスク	940,462	975,088	75,237	78,007
20	うち、基礎的手法適用分	940,462	975,088	75,237	78,007
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	198,560	162,995	15,883	13,040
	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	5,536,310	5,020,849	442,904	401,667

2021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. リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算が適用されるエクスポージャーについて、エクスポージャーの区分ごとの額

(単位 百万円)

	エクスポージャーの額	
リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算(リスク・スルー方式)	481,993	
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)	22,445	
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%)	169	
合計	504,607	

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	
		2021年3月末	2020年3月末	2021年3月末	2020年3月末
1	信用リスク	2,001,097	1,065,998	160,088	85,280
2	うち、標準的手法適用分	973,879	725,737	77,910	58,059
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	1,027,217	340,260	82,177	27,220
4	カウンターパーティ信用リスク	1,216,029	1,015,852	97,282	81,268
5	うち、SA-CCR適用分	502,669	427,491	40,214	34,199
6	うち、期待エクスポージャー 方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	436,339	347,795	34,907	27,823
	うち、中央清算機関関連工 クスポージャー	25,311	15,943	2,025	1,275
	その他	251,710	224,621	20,137	17,969
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(リスク・スルー方式)	274,039	516,553	21,923	41,324
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)	21,507	73,154	1,721	5,851
	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%)	2,119	1,443	169	115
11	未決済取引	9	255	1	20
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	121,219	119,868	9,697	9,589
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	118,851	117,501	9,508	9,400
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—	—	—	—
	うち、1250%のリスク・ ウェイト適用分	2,367	2,367	189	189
16	マーケット・リスク	1,211,121	1,604,159	96,890	128,332
17	うち、標準的方式適用分	857,501	838,138	68,600	67,051
18	うち、内部モデル方式適用分	353,621	766,021	28,290	61,281
19	オペレーショナル・リスク	962,612	940,462	77,009	75,237
20	うち、基礎的手法適用分	962,612	940,462	77,009	75,237
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	198,606	198,560	15,888	15,883
	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	6,008,356	5,536,310	480,669	442,904

2020年3月末

(単位 百万円)

国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2020年3月末	2019年12月末	2020年3月末	2019年12月末
1	信用リスク	1,065,998	1,207,131	85,280	96,570
2	うち、標準的手法適用分	725,737	771,368	58,059	61,709
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	340,260	435,763	27,220	34,861
4	カウンターパーティ信用リスク	1,015,852	954,297	81,268	76,343
5	うち、SA-CCR適用分	427,491	335,232	34,199	26,818
6	うち、期待エクスポージャー 方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	347,795	333,474	27,823	26,677
	うち、中央清算機関関連エ クスポージャー	15,943	19,954	1,275	1,596
	その他	224,621	265,635	17,969	21,250
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(リスク・スルー方式)	516,553	340,116	41,324	27,209
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)	73,154	115,166	5,851	9,213
	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(偶然性方式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(偶然性方式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%)	1,443	2,006	115	160
11	未決済取引	255	227	20	18
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	119,868	123,921	9,589	9,913
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	117,501	121,525	9,400	9,722
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—	—	—	—
	うち、1250%のリスク・ ウェイト適用分	2,367	2,395	189	191
16	マーケット・リスク	1,604,159	1,750,411	128,332	140,032
17	うち、標準的方式適用分	838,138	923,905	67,051	73,912
18	うち、内部モデル方式適用分	766,021	826,506	61,281	66,120
19	オペレーショナル・リスク	940,462	948,297	75,237	75,863
20	うち、基礎的手法適用分	940,462	948,297	75,237	75,863
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	198,560	152,264	15,883	12,181
	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	5,536,310	5,593,840	442,904	447,507

2021年3月末

(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	
		2021年3月末	2020年12月末	2021年3月末	2020年12月末
1	信用リスク	2,001,097	1,252,664	160,088	100,199
2	うち、標準的手法適用分	973,879	888,237	77,910	71,058
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	1,027,217	364,427	82,177	29,140
4	カウンターパーティ信用リスク	1,216,029	1,087,901	97,282	87,032
5	うち、SA-CCR適用分	502,669	452,639	40,214	36,211
6	うち、期待エクスポージャー 方式適用分	—	—	—	—
	うち、CVAリスク	436,339	384,350	34,907	30,748
	うち、中央清算機関関連エ クスポージャー	25,311	20,519	2,025	1,641
	その他	251,710	230,392	20,137	18,431
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(リスク・スルー方式)	274,039	475,514	21,923	38,041
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)	21,507	27,256	1,721	2,180
	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(偶然性方式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(偶然性方式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%)	2,119	543	169	43
11	未決済取引	9	1,096	1	87
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	121,219	117,841	9,697	9,427
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	118,851	115,474	9,508	9,237
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	—	—	—	—
	うち、1250%のリスク・ ウェイト適用分	2,367	2,367	189	189
16	マーケット・リスク	1,211,121	1,097,422	96,890	87,793
17	うち、標準的方式適用分	857,501	809,255	68,600	64,740
18	うち、内部モデル方式適用分	353,621	288,167	28,290	23,053
19	オペレーショナル・リスク	962,612	907,891	77,009	72,631
20	うち、基礎的手法適用分	962,612	907,891	77,009	72,631
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	198,606	192,773	15,888	15,421
	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	6,008,356	5,160,906	480,669	412,872

2020年3月末

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

LI1 その1

(単位 百万円)

		連結貸借 対照表 計上額	連結自己 資本規制 上の連結 範囲に基 づく連結 貸借対照 表計上額	各項目に対応する帳簿価額				所要自己 資本算定 対象外の 項目又は 規制資本 からの 調整項目
				信用 リスク	カウンター パーティ 信用 リスク	証券化 エクス ポージャー	マーケット・ リスク	
	資産							
1	現金・預金	3,964,512	3,969,510	3,969,510	-	-	266,392	-
2	預託金	415,953	415,953	415,953	-	-	27,345	-
3	受取手形及び 売掛金	18,427	18,427	18,427	-	-	-	-
4	有価証券	873,064	873,064	822,958	-	50,105	286,574	-
5	トレーディ ング商品	8,027,289	8,027,289	-	3,583,933	-	8,030,243	△2,954
6	約定見返勘定	-	-	203	-	-	8,202	82,302
7	営業投資有価証券	202,557	202,557	202,557	-	-	41,960	-
8	投資損失引当金	△1,160	△1,160	△1,160	-	-	-	-
9	営業貸付金	1,768,471	1,768,471	1,261,788	-	506,682	356,369	-
10	仕掛品	609	609	609	-	-	-	-
11	信用取引資産	114,384	114,384	-	114,377	-	-	-
12	有価証券担 保貸付金	6,685,756	6,685,756	-	7,369,310	-	3,355,246	-
13	立替金	25,682	25,682	25,682	-	-	115	-
14	短期貸付金	3,087	3,087	3,087	-	-	76,582	-
15	未収収益	36,483	36,594	36,594	-	-	12,757	-
16	繰延税金資産	-	-	-	-	-	3,859	-
17	その他の流動資産	711,935	713,429	688,294	12,157	-	79,250	25,134
18	貸倒引当金	△415	△415	△415	-	-	△289	-
19	流動資産計	22,846,637	22,853,241	7,444,088	11,079,779	556,787	12,544,610	104,482
20	有形固定資産	309,166	313,076	313,076	-	-	19,328	-
21	無形固定資産	124,115	124,176	-	-	-	7,694	124,176
22	のれん	13,629	13,629	-	-	-	5,585	13,629
23	のれん以外	110,486	110,547	-	-	-	2,109	110,547
24	投資その他の資産	542,179	542,093	541,745	-	189	35,149	8
25	投資有価証券	491,660	489,051	488,861	-	189	29,219	-
26	繰延税金資産	17,125	17,133	17,125	-	-	1,985	8
27	上記以外	33,394	35,907	35,758	-	-	3,944	-
28	固定資産計	975,462	979,347	854,822	-	189	62,172	124,184
29	繰延資産計	-	-	-	-	-	-	-
30	資産合計	23,822,099	23,832,588	8,298,911	11,079,779	556,976	12,606,783	228,667

(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。

2021年3月末

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

LI1 その1

(単位 百万円)

		連結貸借 対照表 計上額	連結自己 資本規制 上の連結 範囲に基 づく連結 貸借対照 表計上額	各項目に対応する帳簿価額				所要自己 資本算定 対象外の 項目又は 規制資本 からの 調整項目
				信用 リスク	カウンター パーティ 信用 リスク	証券化 エクス ポージャー	マーケット・ リスク	
資産								
1	現金・預金	4,763,197	4,765,881	4,765,881	-	-	271,709	-
2	預託金	485,876	485,876	485,876	-	-	45,956	-
3	受取手形及 び売掛金	21,488	21,488	21,488	-	-	-	-
4	有価証券	996,683	996,683	947,589	-	131,053	309,929	-
5	トレーディ ング商品	7,834,093	7,834,093	-	2,426,001	-	7,837,582	△3,489
6	約定見返勘定	-	-	-	4,297	-	36	78,438
7	営業投資有価証券	97,092	97,092	97,092	-	-	-	-
8	投資損失引当金	△588	△588	△588	-	-	-	-
9	営業貸付金	1,996,121	1,996,121	1,472,107	-	445,248	337,885	-
10	仕掛品	603	603	603	-	-	-	-
11	信用取引資産	162,078	162,078	-	162,078	-	-	-
12	有価証券担 保貸付金	7,448,321	7,448,321	-	7,766,248	-	2,837,194	-
13	立替金	20,131	20,131	20,131	-	-	66	-
14	短期貸付金	595	595	595	-	-	106	-
15	未収収益	36,229	36,229	36,229	-	-	12,143	-
16	繰延税金資産	-	-	-	-	-	2,800	-
17	その他の流動資産	788,790	789,499	732,445	13,810	-	83,064	35,247
18	貸倒引当金	△4,401	△4,401	△4,401	-	-	△341	-
19	流動資産計	24,646,314	24,649,707	8,575,047	10,372,437	576,301	11,738,135	110,196
20	有形固定資産	880,477	880,604	880,604	-	-	26,973	-
21	無形固定資産	128,786	128,848	-	-	-	6,803	128,848
22	のれん	21,229	21,229	-	-	-	4,650	21,229
23	のれん以外	107,557	107,619	-	-	-	2,152	107,618
24	投資その他の資産	443,751	442,244	438,861	232	189	12,180	5
25	投資有価証券	402,590	401,036	400,845	-	189	7,577	-
26	繰延税金資産	11,397	11,402	11,386	-	-	2,080	5
27	上記以外	29,764	29,805	26,629	232	-	2,522	-
28	固定資産計	1,453,016	1,451,698	1,319,465	232	189	45,958	128,853
29	繰延資産計	-	-	-	-	-	-	-
30	資産合計	26,099,330	26,101,405	9,894,512	10,372,669	576,490	11,784,093	239,049

(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。

2020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	8,938	8,938	-	-	-	-	8,938
32	トレーディング商品	5,362,261	5,362,261	-	3,499,169	-	5,362,261	-
33	約定見返勘定	544,689	544,689	-	8,919	-	366,700	-
34	信用取引負債	59,256	59,256	-	59,252	-	-	-
35	有価証券担保借入金	7,198,730	7,198,730	-	7,883,771	-	4,681,950	-
36	銀行業における預金	4,037,201	4,037,201	-	-	-	-	4,037,201
37	預り金	353,943	360,176	-	-	-	74,939	360,176
38	受入保証金	414,641	414,641	-	17,057	-	4,469	-
39	短期借入金	1,276,948	1,276,948	-	-	-	25,123	1,276,948
40	コマーシャルペーパー	178,000	178,000	-	-	-	-	178,000
41	1年以内償還予定の社債	277,852	277,852	-	-	-	-	277,852
42	未払法人税等	7,403	7,428	-	-	-	1,794	7,428
43	繰延税金負債	-	3	-	-	-	4,064	3
44	賞与引当金	26,747	26,747	-	-	-	12,409	26,747
45	その他の流動負債	172,101	173,255	39,350	43,012	-	70,344	131,403
46	社債	1,379,226	1,379,226	-	-	-	△353	1,379,226
47	長期借入金	1,183,272	1,183,613	-	-	-	-	1,183,613
48	繰延税金負債	4,369	4,369	-	-	-	5	4,369
49	退職給付に係る負債	44,359	44,359	-	-	-	-	44,359
50	訴訟損失引当金	1,570	1,570	-	-	-	-	1,570
51	負ののれん	-	-	-	-	-	-	-
52	その他の固定負債	28,900	29,217	-	-	-	16,745	13,740
53	特別法上の準備金	3,918	3,918	-	-	-	-	3,918
54	負債合計	22,564,333	22,572,408	39,350	11,511,183	-	10,620,453	8,935,499

(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。

2021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	5,382	5,382	-	-	-	-	5,382
32	トレーディング商品	4,367,822	4,367,822	-	2,321,332	-	4,367,822	-
33	約定見返勘定	1,320,279	1,320,279	-	-	-	785,844	-
34	信用取引負債	64,022	64,022	-	64,022	-	-	-
35	有価証券担保借入金	8,176,094	8,176,094	-	8,493,512	-	4,266,123	-
36	銀行業における預金	4,416,097	4,416,097	-	-	-	-	4,416,097
37	預り金	419,994	420,001	-	-	-	48,695	420,001
38	受入保証金	366,351	366,351	355,730	10,621	-	1,993	-
39	短期借入金	1,408,288	1,408,288	-	-	-	55,877	1,408,288
40	コマーシャルペーパー	265,000	265,000	-	-	-	-	265,000
41	1年以内償還予定の社債	203,774	203,774	-	-	-	-	203,774
42	未払法人税等	17,962	18,012	-	-	-	593	17,995
43	繰延税金負債	-	-	-	-	-	2,730	-
44	賞与引当金	36,316	36,316	-	-	-	16,703	36,241
45	その他の流動負債	151,966	152,221	25,438	26,835	-	61,322	126,783
46	社債	1,557,333	1,557,333	-	-	-	-	1,557,333
47	長期借入金	1,586,913	1,586,913	-	-	-	-	1,586,913
48	繰延税金負債	43,176	43,176	105	-	-	6	43,070
49	退職給付に係る負債	44,773	44,773	-	-	-	-	44,768
50	訴訟損失引当金	1,809	1,809	-	-	-	-	1,809
51	負ののれん	-	-	-	-	-	-	-
52	その他の固定負債	50,430	50,547	-	500	-	15,450	36,109
53	特別法上の準備金	3,699	3,699	-	-	-	-	3,699
54	負債合計	24,507,489	24,507,920	381,273	10,916,824	-	9,623,164	10,173,271

(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。

2020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	23,603,921	8,298,911	11,079,779	556,976	12,606,783
2	自己資本比率規制上の連結範囲に基づく負債の額	13,636,909	39,350	11,511,183	-	10,620,453
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	9,967,012	8,259,561	△431,404	556,976	1,986,330
4	オフ・バランスシートの額	110,062	19,901	90,160	-	-
5	保守的な公正価値調整による差異	-	-	-	-	-
6	ネットイング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	6,387,645	-	6,387,645	-	-
10	レボ形式の取引について、ネットイ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	16,187,805	-	16,187,805	-	-
11	その他の差異	△11,859,661	△408,406	△20,573,842	11,304	-
12	自己資本比率規制上のエクスポージャーの額	12,086,030	7,871,056	1,660,364	568,280	1,986,330

(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イ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イ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。

2021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	25,862,355	9,894,512	10,372,669	576,490	11,784,093
2	自己資本比率規制上の連結範囲に基づく負債の額	14,334,649	381,273	10,916,824	-	9,623,164
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	11,527,706	9,513,239	△544,155	576,490	2,160,929
4	オフ・バランスシートの額	199,092	21,952	177,139	-	-
5	保守的な公正価値調整による差異	-	-	-	-	-
6	ネットイング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	3,680,082	-	3,680,082	-	-
10	レボ形式の取引について、ネットイ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	17,377,446	-	17,377,446	-	-
11	その他の差異	△8,415,160	30,551	△18,572,240	13,510	-
12	自己資本比率規制上のエクスポージャーの額	14,434,944	9,565,743	2,118,272	590,000	2,160,929

(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イ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イ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。

2020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	—	1,267,055	43	1,267,011
2	有価証券(うち負債性のもの)	—	696,509	—	696,509
3	その他オン・バランスシート の資産(うち負債性のもの)	722	4,081,820	2,223	4,080,319
4	オン・バランスシートの資産 の合計(1+2+3)	722	6,045,385	2,267	6,043,839
	オフ・バランスシートの資産				
5	支払承諾等	—	15,578	—	15,578
6	コミットメント等	—	19,060	—	19,060
7	オフ・バランスシートの資産 の合計(5+6)	—	34,639	—	34,639
	合計				
8	合計(4+7)	722	6,080,024	2,267	6,078,479

(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:2019年9月末 当期末:2020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	41
2	貸出金・有価証券等 (うち負債性のもの) デフォルトした額	0
3	非デフォルト状態へ復帰した額	—
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	680
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)	722

(注)「その他の変動額」に記載の変動額のうち、主な発生要因としてはデフォルト状態にあるエクスポージャーの回収による残高減少が挙げられます。

【CR3】信用リスク削減手法

(単位 百万円)

	非保全エク スポージャー	保全された エクスポージャー	担保で保全 されたエク スポージャー	保証で保全 されたエク スポージャー	クレジット・ デリバティ ブで保全さ れたエク スポージャー
1	貸出金	1,133,882	133,129	133,129	—
2	有価証券 (負債性のもの)	696,509	—	—	—
3	その他オン・バラン スシートの資産 (負債性のもの)	4,080,314	4	4	—
4	合計(1+2+3)	5,910,706	133,134	133,134	—
5	うちデフォルト したものの	706	—	—	—

2021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	—	1,479,283	7,684	1,471,600
2	有価証券(うち負債性のもの)	—	843,313	—	843,313
3	その他オン・バランスシート の資産(うち負債性のもの)	30,862	4,901,778	2,161	4,930,479
4	オン・バランスシートの資産 の合計(1+2+3)	30,862	7,224,374	9,844	7,245,392
	オフ・バランスシートの資産				
5	支払承諾等	—	13,689	—	13,689
6	コミットメント等	—	19,054	—	19,054
7	オフ・バランスシートの資産 の合計(5+6)	—	32,743	—	32,743
	合計				
8	合計(4+7)	30,862	7,257,117	9,844	7,278,135

(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:2020年9月末 当期末:2021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	620
2	貸出金・有価証券等 (うち負債性のもの) デフォルトした額	0
3	非デフォルト状態へ復帰した額	—
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	30,241
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)	30,862

(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連結範囲の変更に伴い計上対象となった、不良債権の残高増加が挙げられます。

【CR3】信用リスク削減手法

(単位 百万円)

	非保全エク スポージャー	保全された エクスポージャー	担保で保全 されたエク スポージャー	保証で保全 されたエク スポージャー	クレジット・ デリバティ ブで保全さ れたエク スポージャー
1	貸出金	1,293,206	178,394	178,394	—
2	有価証券 (負債性のもの)	843,313	—	—	—
3	その他オン・バラン スシートの資産 (負債性のもの)	4,930,474	5	5	—
4	合計(1+2+3)	7,066,993	178,399	178,399	—
5	うちデフォルト したものの	30,776	—	—	—

2020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 (RWA density)
		オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額	オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額		
1	現金	-	-	-	-	-	-
2	日本国政府及び日本銀行向け	4,612,794	-	4,612,794	-	-	0.00%
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	167,935	-	167,935	-	91	0.05%
4	国際決済銀行等向け	-	-	-	-	-	-
5	我が国の地方公共団体向け	-	-	-	-	-	-
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	1,679	-	1,679	-	409	24.36%
7	国際開発銀行向け	104	-	104	-	-	0.00%
8	地方公共団体金融機構向け	1,203	-	1,203	-	238	19.78%
9	我が国の政府関係機関向け	264,031	-	264,031	-	28,610	10.84%
10	地方三公社向け	6	-	6	-	1	16.67%
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	511,786	19,060	511,786	3,812	106,683	20.69%
12	法人等向け	414,847	15,579	281,713	14,682	294,287	99.29%
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	14,281	2,895	14,281	2,895	17,176	100.00%
16	三月以上延滞等(抵当権付住宅ローンを除く。)	706	-	706	-	1,046	148.16%
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。)	275,828	2,724	275,828	1,362	277,191	100.00%
22	合計	6,265,205	40,259	6,132,071	22,751	725,737	11.79%

2021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 (RWA density)
		オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額	オン・バランスシートの額	オフ・バランスシートの額		
1	現金	-	-	-	-	-	-
2	日本国政府及び日本銀行向け	5,486,908	-	5,486,908	-	-	0.00%
3	外国の中央政府及び中央銀行向け	127,342	-	127,342	-	43	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	15,464	-	15,464	-	-	0.00%
6	外国の中央政府等以外の公共部門向け	487	-	487	-	139	28.45%
7	国際開発銀行向け	9,162	-	9,162	-	-	0.00%
8	地方公共団体金融機構向け	9,294	-	9,294	-	1,859	20.00%
9	我が国の政府関係機関向け	330,024	-	330,024	-	36,514	11.06%
10	地方三公社向け	0	-	0	-	0	20.00%
11	金融機関及び第一種金融商品取引業者向け	881,700	19,029	881,700	3,806	180,925	20.43%
12	法人等向け	632,774	30,557	454,375	18,083	452,697	95.82%
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	18,581	2,585	18,581	2,585	21,167	100.00%
16	三月以上延滞等(抵当権付住宅ローンを除く。)	30,776	-	30,776	-	46,165	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。)	233,572	1,598	233,572	799	234,371	100.00%
22	合計	7,776,085	53,769	7,597,686	25,274	973,879	12.78%

2020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		4,612,794	-	-	-	-	-
3 外国の中央政府及び中央銀行向け		167,620	-	219	-	94	-
4 国際決済銀行等向け		-	-	-	-	-	-
5 我が国の地方公共団体向け		-	-	-	-	-	-
6 外国の中央政府等以外の公共部門向け		-	-	1,587	-	-	-
7 国際開発銀行向け		104	-	-	-	-	-
8 地方公共団体金融機構向け		-	24	1,179	-	-	-
9 我が国の政府関係機関向け		-	241,954	22,076	-	-	-
10 地方三公社向け		-	-	6	-	-	-
11 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け		-	-	510,744	-	636	-
12 法人等向け		-	-	1,863	-	1,236	-
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。)		-	-	-	-	13	-
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		4,780,519	241,979	537,677	-	1,980	-

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		-	-	-	-	4,612,794
3 外国の中央政府及び中央銀行向け		-	-	-	-	167,935
4 国際決済銀行等向け		-	-	-	-	-
5 我が国の地方公共団体向け		-	-	-	-	-
6 外国の中央政府等以外の公共部門向け		92	-	-	-	1,679
7 国際開発銀行向け		-	-	-	-	104
8 地方公共団体金融機構向け		-	-	-	-	1,203
9 我が国の政府関係機関向け		-	-	-	-	264,031
10 地方三公社向け		-	-	-	-	6
11 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け		4,217	-	-	-	515,598
12 法人等向け		293,296	-	-	-	296,396
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		17,176	-	-	-	17,176
16 三月以上延滞等(抵当権付住宅ローンを除く。)		-	693	-	-	706
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。)		277,191	-	-	-	277,191
22 合計		591,974	693	-	-	6,154,824

2021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		5,486,908	-	-	-	-	-
3 外国の中央政府及び中央銀行向け		127,257	-	-	-	84	-
4 国際決済銀行等向け		-	-	-	-	-	-
5 我が国の地方公共団体向け		15,464	-	-	-	-	-
6 外国の中央政府等以外の公共部門向け		-	-	436	-	-	-
7 国際開発銀行向け		9,162	-	-	-	-	-
8 地方公共団体金融機構向け		-	3	9,291	-	-	-
9 我が国の政府関係機関向け		-	294,908	35,116	-	-	-
10 地方三公社向け		-	-	0	-	-	-
11 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け		-	-	880,367	-	575	-
12 法人等向け		-	-	12,007	-	20,317	-
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		5,638,791	294,911	937,216	-	20,976	-

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		-	-	-	-	5,486,908
3 外国の中央政府及び中央銀行向け		1	-	-	-	127,342
4 国際決済銀行等向け		-	-	-	-	-
5 我が国の地方公共団体向け		-	-	-	-	15,464
6 外国の中央政府等以外の公共部門向け		51	-	-	-	487
7 国際開発銀行向け		-	-	-	-	9,162
8 地方公共団体金融機構向け		-	-	-	-	9,294
9 我が国の政府関係機関向け		-	-	-	-	330,024
10 地方三公社向け		-	-	-	-	0
11 金融機関及び第一種金融商品取引業者向け		4,563	-	-	-	885,506
12 法人等向け		440,135	-	-	0	472,459
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		21,167	-	-	-	21,167
16 三月以上延滞等(抵当権付住宅ローンを除く。)		-	30,776	-	-	30,776
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。)		234,371	-	-	-	234,371
22 合計		700,289	30,776	-	0	7,622,960

2020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	233,508	222,878		1.4	638,941	427,491
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					423,439	224,621
5	エクスポージャー変動推計モデル					-	-
6	合計						652,113

【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・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	578,287	347,795
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	578,287	347,795

【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)

	リスク・ウェイト	与信相当額(信用リスク削減効果勘案後)		
業種		0%	10%	20%
1	日本国政府及び日本銀行向け	6,755	-	-
2	外国の中央政府及び中央銀行向け	40,618	-	2,159
3	国際決済銀行等向け	40,727	-	-
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	-	-	29,123
6	国際開発銀行向け	9,307	-	-
7	地方公共団体金融機構向け	-	-	9,486
8	我が国の政府関係機関向け	-	5,336	406
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	-	-	332,828
11	法人等向け	-	-	5,483
12	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-
13	上記以外	-	-	-
14	合計	97,409	5,336	379,487

2021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	189,999	341,787		1.4	744,502	502,669
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					455,405	251,709
5	エクスポージャー変動推計モデル					-	-
6	合計						754,378

【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・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	675,180	436,339
5	CVAリスク相当額の対象となるポートフォリオの合計	675,180	436,339

【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)

	リスク・ウェイト	与信相当額(信用リスク削減効果勘案後)		
業種		0%	10%	20%
1	日本国政府及び日本銀行向け	6,046	-	-
2	外国の中央政府及び中央銀行向け	33,711	-	2,103
3	国際決済銀行等向け	50,275	-	-
4	我が国の地方公共団体向け	529	-	-
5	外国の中央政府等以外の公共部門向け	-	-	25,577
6	国際開発銀行向け	7,806	-	-
7	地方公共団体金融機構向け	-	-	2,381
8	我が国の政府関係機関向け	-	2,895	9,563
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	-	-	369,273
11	法人等向け	-	-	7,262
12	中小企業等向け及び個人向け	-	-	-
13	上記以外	-	-	-
14	合計	98,370	2,895	416,162

2020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		46	—	74
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		71	—	—
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		1,204	—	—
11 法人等向け		7,609	—	571,141
12 中小企業等向け及び個人向け		—	—	—
13 上記以外		—	—	—
14 合計		8,931	—	571,216

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		—	—	6,755
2 外国の中央政府及び中央銀行向け		—	—	42,899
3 国際決済銀行等向け		—	—	40,727
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		—	—	29,194
6 国際開発銀行向け		—	—	9,307
7 地方公共団体金融機構向け		—	—	9,486
8 我が国の政府関係機関向け		—	—	5,742
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		—	—	334,033
11 法人等向け		—	—	584,234
12 中小企業等向け及び個人向け		—	—	—
13 上記以外		—	—	—
14 合計		—	—	1,062,381

【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)	23,611	158,654	181,158	262,257	4,181,819	3,157,753
2 現金(その他通貨)	64,974	16,022	2,497	22,584	5,134,591	4,343,763
3 国内ソブリン債	215	27,101	—	8,803	2,341,721	2,841,176
4 その他ソブリン債	415	—	—	6,228	3,889,546	4,011,612
5 政府関係機関債	1,304	—	—	—	639,519	1,267,750
6 社債	35,756	—	—	—	35,592	86,505
7 株式	9,438	637	13,987	105	436,154	173,361
8 その他担保	3,546	—	—	—	18,314	35,328
9 合計	139,264	202,416	197,643	299,978	16,677,259	15,917,252

(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。

2021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		9	—	4
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		2,112	—	—
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		553	—	—
11 法人等向け		20,568	—	659,229
12 中小企業等向け及び個人向け		—	—	—
13 上記以外		—	—	—
14 合計		23,244	—	659,234

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		—	—	6,046
2 外国の中央政府及び中央銀行向け		—	—	35,829
3 国際決済銀行等向け		—	—	50,275
4 我が国の地方公共団体向け		—	—	529
5 外国の中央政府等以外の公共部門向け		—	—	27,690
6 国際開発銀行向け		—	—	7,806
7 地方公共団体金融機構向け		—	—	2,381
8 我が国の政府関係機関向け		—	—	12,459
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		—	—	369,827
11 法人等向け		—	—	687,060
12 中小企業等向け及び個人向け		—	—	—
13 上記以外		—	—	—
14 合計		—	—	1,199,907

【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)	33,856	167,163	108,866	291,499	5,698,901	4,283,001
2 現金(その他通貨)	33,752	15,844	729	23,342	4,447,425	3,663,122
3 国内ソブリン債	268	25,542	—	8,989	3,222,244	4,150,875
4 その他ソブリン債	732	—	—	—	3,303,983	3,596,037
5 政府関係機関債	1,288	—	—	—	603,833	832,547
6 社債	40,481	—	—	—	30,472	85,289
7 株式	13,618	2,031	36,487	41,462	576,011	270,222
8 その他担保	3,494	—	—	—	24,533	46,072
9 合計	127,493	210,581	146,083	365,294	17,907,405	16,927,168

(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。

2020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	654,169	887,103
2	インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ	564,545	447,780
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	1,218,714	1,334,883
	公正価値		
7	プラスの公正価値(資産)	9,684	8,897
8	マイナスの公正価値(負債)	△7,746	△26,746

【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)		15,943
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。)	332,139	6,642
3	(i) 派生商品取引(上場以外)	148,603	2,972
4	(ii) 派生商品取引(上場)	27,816	556
5	(iii) レボ形式の取引	155,720	3,114
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	210,443	
8	分別管理されていない当初証拠金	505	648
9	事前提出された清算基金	54,893	8,652
10	未提出の清算基金	—	—
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	事前提出された清算基金	—	—
20	未提出の清算基金	—	—

【SEC1】原資産の種類別の証券化エクスポージャー(信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーに限る。)

(単位 百万円)

	原資産の種類	自金融機関がオリジネーター 資産譲渡 型証券化 取引	合成型証 券化取引	小計
1	リテール(合計)	—	—	—
2	担保付住宅ローン	—	—	—
3	クレジットカード債権	—	—	—
4	その他リテールに係るエクスポージャー	—	—	—
5	再証券化	—	—	—
6	ホールセール(合計)	—	—	—
7	事業法人向けローン	—	—	—
8	商業用モーゲージ担保証券	—	—	—
9	リース債権及び売掛債権	—	—	—
10	その他のホールセール	—	—	—
11	再証券化	—	—	—

2021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	572,395	814,518
2	インデックス・クレジット・デフォルト・スワップ	782,046	594,726
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	1,354,441	1,409,244
	公正価値		
7	プラスの公正価値(資産)	416	24,099
8	マイナスの公正価値(負債)	△24,795	△2,253

【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)		25,311
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。)	709,839	14,384
3	(i) 派生商品取引(上場以外)	420,217	8,661
4	(ii) 派生商品取引(上場)	84,708	1,694
5	(iii) レボ形式の取引	204,914	4,029
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	146,041	
8	分別管理されていない当初証拠金	13,781	522
9	事前提出された清算基金	48,704	10,406
10	未提出の清算基金	—	—
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	事前提出された清算基金	—	—
20	未提出の清算基金	—	—

【SEC1】原資産の種類別の証券化エクスポージャー(信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャーに限る。)

(単位 百万円)

	原資産の種類	自金融機関がオリジネーター 資産譲渡 型証券化 取引	合成型証 券化取引	小計
1	リテール(合計)	—	—	—
2	担保付住宅ローン	—	—	—
3	クレジットカード債権	—	—	—
4	その他リテールに係るエクスポージャー	—	—	—
5	再証券化	—	—	—
6	ホールセール(合計)	—	—	—
7	事業法人向けローン	—	—	—
8	商業用モーゲージ担保証券	—	—	—
9	リース債権及び売掛債権	—	—	—
10	その他のホールセール	—	—	—
11	再証券化	—	—	—

2020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)	176,297	—	176,297
2	担保付住宅ローン	108,125	—	108,125
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	68,171	—	68,171
5	再証券化	—	—	—
6	ホールセール(合計)	391,983	—	391,983
7	事業法人向けローン	391,794	—	391,794
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	189	—	189
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)	1,571	—	1,571
2	担保付住宅ローン	1,571	—	1,571
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	—	—	—

2021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)	215,761	—	215,761
2	担保付住宅ローン	130,162	—	130,162
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	85,599	—	85,599
5	再証券化	—	—	—
6	ホールセール(合計)	374,239	—	374,239
7	事業法人向けローン	374,050	—	374,050
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	189	—	189
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)	1,261	—	1,261
2	担保付住宅ローン	1,261	—	1,261
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	—	—	—

2020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)	0	—	0
2	担保付住宅ローン	0	—	0
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)	—	9,504	9,504
7	事業法人向けローン	—	9,504	9,504
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。

2021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)	—	—	—
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)	—	1,106	1,106
7	事業法人向けローン	—	1,106	1,106
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。

2020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 譲渡型 証券化 取引 (小計)	証券化			
			裏付け となる リテール	ホール セール		
	エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)					
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	553,591	553,591	553,591	161,797	391,794
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	10,000	10,000	10,000	10,000	-
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	4,500	4,500	4,500	4,500	-
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	189	189	189	-	189
	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	568,091	568,091	568,091	176,297	391,794
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	189	189	189	-	189
	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	117,501	117,501	117,501	39,142	78,358
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	2,367	2,367	2,367	-	2,367
	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	9,400	9,400	9,400	3,131	6,268
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	189	189	189	-	189

2021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				
		譲渡型証券化取引 (小計)	証券化			
				裏付けとなる リテール	ホール セール	
	エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区分別)					
1	20%以下のリスク・ウェイトが適用される証券化エクスポージャー	585,311	585,311	585,311	211,261	374,050
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	4,500	4,500	4,500	4,500	-
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	189	189	189	-	189
	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	589,811	589,811	589,811	215,761	374,050
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	189	189	189	-	189
	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	118,851	118,851	118,851	44,041	74,810
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	2,367	2,367	2,367	-	2,367
	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	9,508	9,508	9,508	3,523	5,985
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	189	189	189	-	189

2020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			
	エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区別)					
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	-	-	-	-	-

2021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			
	エクスポージャーの額(リスク・ウェイト区別)					
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	-	-	-	-	-

2020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	-	-	-	-	-

2021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	-	-	-	-	-

2020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	616,981
2 株式リスク(一般市場リスク及び個別リスク)の額	94,757
3 外国為替リスクの額	108,319
4 コモディティ・リスクの額	—
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	18,080
9 合計	838,138

【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:2019年3月末 当期末:2020年3月末	バリュー・ アット・ リスク	ストレ・ 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	174,078	518,038	—	—	—	—	692,117
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	3.48	3.47	—	—	—	—	3.48
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	49,951	149,111	—	—	—	—	199,062
2 リスク量の変動	△7,820	17,674	—	—	—	—	9,853
3 モデルの更新又は変更	—	—	—	—	—	—	—
4 当期中の要因別の変動額	—	—	—	—	—	—	—
5 手法及び方針	—	—	—	—	—	—	—
6 買収及び売却	—	—	—	—	—	—	—
7 為替の変動	—	—	—	—	—	—	—
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	42,130	166,785	—	—	—	—	208,915
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	5.20	3.27	—	—	—	—	3.66
8c 当期末におけるリスク・アセット	219,240	546,781	—	—	—	—	766,021

(単位 百万円)

	前四半期末:2019年12月末 当四半期末:2020年3月末	バリュー・ アット・ リスク	ストレ・ 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	211,398	615,107	—	—	—	—	826,506
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	4.56	4.72	—	—	—	—	4.68
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	46,332	130,112	—	—	—	—	176,444
2 リスク量の変動	△4,202	36,672	—	—	—	—	32,470
3 モデルの更新又は変更	—	—	—	—	—	—	—
4 当四半期の要因別の変動額	—	—	—	—	—	—	—
5 手法及び方針	—	—	—	—	—	—	—
6 買収及び売却	—	—	—	—	—	—	—
7 為替の変動	—	—	—	—	—	—	—
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	42,130	166,785	—	—	—	—	208,915
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	5.20	3.27	—	—	—	—	3.66
8c 当四半期末におけるリスク・アセット	219,240	546,781	—	—	—	—	766,021

2021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	585,259
2 株式リスク(一般市場リスク及び個別リスク)の額	134,435
3 外国為替リスクの額	125,606
4 コモディティ・リスクの額	—
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	12,198
9 合計	857,500

【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:2020年3月末 当期末:2021年3月末	バリュー・ アット・ リスク	ストレ・ 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	219,240	546,781	—	—	—	—	766,021
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	5.20	3.27	—	—	—	—	3.66
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	42,130	166,785	—	—	—	—	208,915
2 リスク量の変動	30,632	△90,813	—	—	—	—	△60,181
3 モデルの更新又は変更	—	—	—	—	—	—	—
4 当期中の要因別の変動額	—	—	—	—	—	—	—
5 手法及び方針	—	—	—	—	—	—	—
6 買収及び売却	—	—	—	—	—	—	—
7 為替の変動	—	—	—	—	—	—	—
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	72,762	75,971	—	—	—	—	148,734
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	2.24	2.50	—	—	—	—	2.37
8c 当期末におけるリスク・アセット	163,202	190,417	—	—	—	—	353,620

(単位 百万円)

	前四半期末:2020年12月末 当四半期末:2021年3月末	バリュー・ アット・ リスク	ストレ・ 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	105,650	182,516	—	—	—	—	288,167
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	2.06	3.50	—	—	—	—	2.78
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	51,285	52,062	—	—	—	—	103,348
2 リスク量の変動	21,477	23,908	—	—	—	—	45,385
3 モデルの更新又は変更	—	—	—	—	—	—	—
4 当四半期の要因別の変動額	—	—	—	—	—	—	—
5 手法及び方針	—	—	—	—	—	—	—
6 買収及び売却	—	—	—	—	—	—	—
7 為替の変動	—	—	—	—	—	—	—
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	72,762	75,971	—	—	—	—	148,734
8b 当四半期末における連結自己資本規制上のリスク・アセット額への調整	2.24	2.50	—	—	—	—	2.37
8c 当四半期末におけるリスク・アセット	163,202	190,417	—	—	—	—	353,620

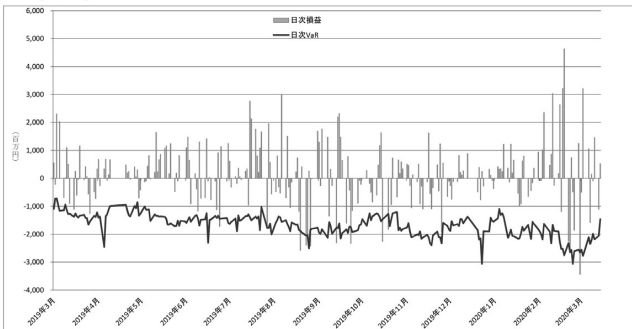
2020年3月末

【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	8,736
2	平均値	4,568
3	最小値	2,612
4	期末	3,370
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	19,606
6	平均値	13,215
7	最小値	5,715
8	期末	13,342
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



【IRRB1】金利リスク

(単位 百万円)

			△EVE	
			2020年3月末	2019年3月末
1	上方パラレルシフト		4,392	4,691
2	下方パラレルシフト		24,566	32,156
3	スティープ化		664	1,632
4	フラット化		309	430
5	短期金利上昇		1,943	1,718
6	短期金利低下		14,668	18,699
7	最大値		24,566	32,156
			2020年3月末	2019年3月末
8	Tier1 資本の額		1,171,864	1,086,889

(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。

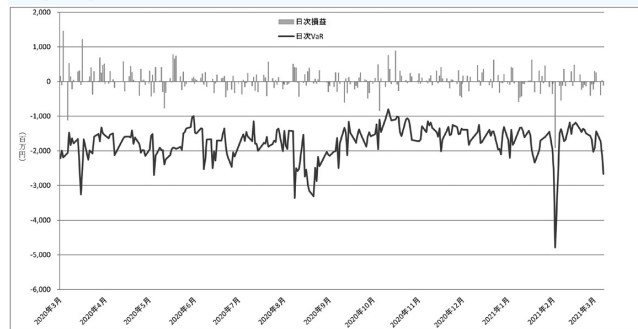
2021年3月末

【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	20,204
2	平均値	3,480
3	最小値	1,500
4	期末	5,821
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	16,136
6	平均値	7,111
7	最小値	1,980
8	期末	6,077
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



【IRRB1】金利リスク

(単位 百万円)

			△EVE	
			2021年3月末	2020年3月末
1	上方パラレルシフト		8,123	4,392
2	下方パラレルシフト		19,572	24,566
3	スティープ化		3,698	664
4	フラット化		358	309
5	短期金利上昇		1,717	1,943
6	短期金利低下		12,363	14,668
7	最大値		19,572	24,566
			2021年3月末	2020年3月末
8	Tier1 資本の額		1,305,210	1,171,864

(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。

2020年3月末

【CCyB1】カウンター・シクリカル・バッファ比率に係る国又は地域別の状況
(単位 百万円)

国又は地域	各金融当局が定める比率	カウンター・シクリカル・バッファ比率の計算に用いた当該国又は地域に係る信用リスク・アセットの額	カウンター・シクリカル・バッファ比率	カウンター・シクリカル・バッファの額
香港	1.00%	14,913		
ルクセンブルク	0.25%	2,755		
ドイツ	0.25%	6		
小計		17,674		
合計		2,409,513	0.00%	155

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

2021年3月末

【CCyB1】カウンター・シクリカル・バッファ比率に係る国又は地域別の状況
(単位 百万円)

国又は地域	各金融当局が定める比率	カウンター・シクリカル・バッファ比率の計算に用いた当該国又は地域に係る信用リスク・アセットの額	カウンター・シクリカル・バッファ比率	カウンター・シクリカル・バッファの額
香港	1.00%	14,394		
ルクセンブルク	0.50%	926		
小計		15,321		
合計		3,198,466	0.00%	148

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

2020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	2020年 3月末	2019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	13,296,069	12,041,187
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	23,822,099	21,126,706
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。)	10,489	-
1d	3	連結貸借対照表における総資産の額から控除される調整項目以外の資産の額(△)	10,536,519	9,085,519
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	171,773	137,328
3		オン・バランス資産の額 (イ)	13,124,296	11,903,859
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	646,487	489,419
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	434,611	395,086
6		連結貸借対照表から控除されているデリバティブ取引等に関連して差し入れた担保の対価の額	-	-
7		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた変動証拠金の対価の額のうち控除する額(△)	111,454	106,899
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	1,334,883	1,110,451
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(△)	1,038,287	830,277
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	1,266,240	1,057,780
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	7,782,809	6,540,957
13		レボ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	2,260,394	1,070,592
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	157,448	163,474
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)	5,679,863	5,633,839
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	205,382	122,854
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(△)	75,620	43,528
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	129,762	79,326
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	1,171,864	1,086,889
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	20,200,161	18,674,804
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	5.80%	5.82%

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。

2021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	2021年 3月末	2020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	11,898,008	13,296,069
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	21,973,181	23,822,099
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。)	2,075	10,489
1d	3	連結貸借対照表における総資産の額から控除される調整項目以外の資産の額(△)	10,077,248	10,536,519
2	7	Tier1資本に係る調整項目の額(△)	188,100	171,773
3		オン・バランス資産の額 (イ)	11,709,908	13,124,296
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	603,503	646,487
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	795,392	434,611
6		連結貸借対照表から控除されているデリバティブ取引等に関連して差し入れた担保の対価の額	-	-
7		デリバティブ取引等に関連して現金で差し入れた変動証拠金の対価の額のうち控除する額(△)	43,581	111,454
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	1,409,244	1,334,883
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(△)	1,102,275	1,038,287
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	1,662,283	1,266,240
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	8,405,765	7,782,809
13		レボ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	3,143,476	2,260,394
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	157,761	157,448
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)	5,420,050	5,679,863
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	177,566	205,382
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(△)	53,112	75,620
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	124,454	129,762
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	1,305,210	1,171,864
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	18,916,695	20,200,161
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	6.89%	5.80%
日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率 (6)				
		総エクスポージャーの額 (ヘ)	18,916,695	
		日本銀行に対する預け金の額	4,126,149	
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の総エクスポージャーの額 (ヘ')	23,042,844	
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ'))	5.66%	

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差異の原因は、分母の「総エクスポージャーの額」から日本銀行に対する預け金の額を控除したことによるものです。

2020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
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) ー
	規制上の取り扱い	(2) ー
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	(3) 大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	普通株式
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額	(4) ー
	連結自己資本規制比率	1,189,921百万円
9	額面総額	(5) ー
10	表示される科目の区分	(6) ー
	連結貸借対照表	株主資本
11	発行日	(7) ー
12	償還期限の有無	無
13	その日付	ー
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) ー
	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) ー
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) ー
	剰余金の配当又は利息の支払	ー
17	配当率又は利率の種別	(11) 変動
18	配当率又は利率	(12) ー
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) ー
25	転換の範囲	(16) ー
26	転換の比率	(17) ー
27	転換に係る発行者の裁量の有無	(18) ー
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	ー
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	ー
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) ー
32	元本の削減が生じる範囲	(21) ー
33	元本回復特約の有無	(22) ー
34	その概要	ー
34a	劣後性の手段	(23) ー
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	(24) 永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無	(25) 無
37	非充足資本等要件の内容	(25) ー

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) ー	ー
	規制上の取り扱い	(2) ー	ー
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	(3) 大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2006年7月発行新株予約権	2007年7月発行新株予約権

2021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
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) ー
	規制上の取り扱い	(2) ー
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	(3) 大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	普通株式
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額	(4) ー
	連結自己資本規制比率	1,244,539百万円
9	額面総額	(5) ー
10	表示される科目の区分	(6) ー
	連結貸借対照表	株主資本
11	発行日	(7) ー
12	償還期限の有無	無
13	その日付	ー
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) ー
	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) ー
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) ー
	剰余金の配当又は利息の支払	ー
17	配当率又は利率の種別	(11) 変動
18	配当率又は利率	(12) ー
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) ー
25	転換の範囲	(16) ー
26	転換の比率	(17) ー
27	転換に係る発行者の裁量の有無	(18) ー
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	ー
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	ー
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) ー
32	元本の削減が生じる範囲	(21) ー
33	元本回復特約の有無	(22) ー
34	その概要	ー
34a	劣後性の手段	(23) ー
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	(24) 永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無	(25) 無
37	非充足資本等要件の内容	(25) ー

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) ー	ー
	規制上の取り扱い	(2) ー	ー
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	(3) 大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2006年7月発行新株予約権	2007年7月発行新株予約権

2020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)		
	連結自己資本規制比率	130百万円	175百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2006年7月1日	2007年7月1日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段 (23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。) (1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2008年7月発行新株予約権	2009年7月発行新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	162百万円	229百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2008年7月1日	2009年7月1日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無

2021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)		
	連結自己資本規制比率	94百万円	133百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2006年7月1日	2007年7月1日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段 (23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。) (1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	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	126百万円	190百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2008年7月1日	2009年7月1日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無

2020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における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2010年7月発行新株予約権	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 (4)		
	連結自己資本規制比率	273百万円	171百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2010年7月1日	2010年9月1日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量

2021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における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2010年7月発行新株予約権	2011年7月発行新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	249百万円	339百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2010年7月1日	2011年7月1日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量

2020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	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段 (23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	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 (4)		
	連結自己資本規制比率	356百万円	192百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2011年7月1日	2011年9月5日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	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	—	—

2021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	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段 (23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	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	124百万円	394百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2011年9月5日	2013年2月12日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—

2020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	劣後性の手段 (23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2013年2月発行新株予約権	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 (4)		
	連結自己資本規制比率	410百万円	962百万円
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	2013年2月12日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段 (23)	—	—

2021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	劣後性の手段 (23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	第9回新株予約権	2014年2月発行新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	947百万円	335百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2013年2月12日	2014年2月10日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段 (23)	—	—

2020年3月末			
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。) (1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	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 (4)		
	連結自己資本規制比率	344百万円	1,082百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2014年2月10日	2014年2月10日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段 (23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

2021年3月末			
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。) (1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	第10回新株予約権	2015年2月発行新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	1,058百万円	364百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2014年2月10日	2015年2月9日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段 (23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

2020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
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。)	—	—
	規制上の取り扱い		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	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	372百万円	951百万円
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	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	—	—
	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	—	—
34a	劣後性の手段	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無	無	無
37	非充足資本等要件の内容	—	—

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
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。)	—	—
	規制上の取り扱い		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額

2021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
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。)	—	—
	規制上の取り扱い		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	第11回新株予約権	2016年2月発行新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	928百万円	366百万円
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	2016年2月16日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	—	—
	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	—	—
34a	劣後性の手段	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無	無	無
37	非充足資本等要件の内容	—	—

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
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。)	—	—
	規制上の取り扱い		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額

2020年3月末			
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	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 (4)		
	連結自己資本規制比率	370百万円	472百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2016年2月16日	2016年2月16日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段 (23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後内容に有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2017年2月発行新株予約権	第13回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	398百万円	639百万円
9	額面総額 (5)	—	—

2021年3月末			
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	第12回新株予約権	2017年2月発行新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	489百万円	393百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2016年2月16日	2017年2月8日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段 (23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後内容に有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	第13回新株予約権	2018年2月発行新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	845百万円	429百万円
9	額面総額 (5)	—	—

2020年3月末			
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	2017年2月8日	2017年2月8日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	—	—
	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	—	—
34a	劣後性の手段	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無	無	無
37	非充足資本等要件の内容	—	—

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
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。)	—	—
	規制上の取り扱い		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	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	432百万円	445百万円
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	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	—	—

2021年3月末			
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	2017年2月8日	2018年2月8日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	—	—
	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	—	—
34a	劣後性の手段	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無	無	無
37	非充足資本等要件の内容	—	—

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
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。)	—	—
	規制上の取り扱い		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	第14回新株予約権	第15回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額		
	連結自己資本規制比率	653百万円	422百万円
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8月10日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額	—	—

2020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における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い(2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	第15回新株予約権	第16回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)		
	連結自己資本規制比率	264百万円	62百万円
9	額面総額(5)	—	—
10	表示される科目の区分(6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日(7)	2018年8月10日	2019年8月15日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別(11)	変動	変動
18	配当率又は利率(12)	—	—
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無

2021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における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い(2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	第16回新株予約権	第17回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)		
	連結自己資本規制比率	156百万円	80百万円
9	額面総額(5)	—	—
10	表示される科目の区分(6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日(7)	2019年8月15日	2020年8月17日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別(11)	変動	変動
18	配当率又は利率(12)	—	—
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無

2020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における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	サムティ・レジデンシャル投資法人
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無
3	準拠法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。)(1)	—
	規制上の取り扱い(2)	
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 Tier2資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 Tier2資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	普通株式
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)	
	連結自己資本規制比率	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 6,576百万円 Tier2資本に係る基礎項目の額 1,547百万円
9	額面総額(5)	—
10	表示される科目の区分 連結貸借対照表	非支配株主持分
11	発行日(7)	—
12	償還期限の有無	無
13	その日付	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	—
	剰余金の配当又は利息の支払	
17	配当率又は利率の種別(11)	変動
18	配当率又は利率(12)	—
19	配当等停止条項の有無(13)	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無
24	転換が生じる場合(15)	—
25	転換の範囲(16)	—
26	転換の比率(17)	—

2021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における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券オフィス投資法人	サムティ・レジデンシャル投資法人
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	—	—
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い(2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 Tier2資本に係る基礎項目の額	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 Tier2資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 Tier2資本に係る基礎項目の額	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 Tier2資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	普通株式	普通株式
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)		
	連結自己資本規制比率	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 40,248百万円 Tier2資本に係る基礎項目の額 9,470百万円	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 7,140百万円 Tier2資本に係る基礎項目の額 1,680百万円
9	額面総額(5)	—	—
10	表示される科目の区分 連結貸借対照表	非支配株主持分	非支配株主持分
11	発行日(7)	—	—
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	—	—
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別(11)	変動	変動
18	配当率又は利率(12)	—	—
19	配当等停止条項の有無(13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合(15)	—	—
25	転換の範囲(16)	—	—
26	転換の比率(17)	—	—

2020年3月末		
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—
34	その概要	—
34a	劣後性の手段 (23)	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	JP350220AL30	JP350220BL39
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い(2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	その他Tier1資本に係る基礎項目の額	その他Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	その他Tier1資本に係る基礎項目の額	その他Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	第1回任意償還条項付無担保永久社債(債務免除特約および劣後特約付)	第2回任意償還条項付無担保永久社債(債務免除特約および劣後特約付)
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)		
	連結自己資本規制比率	116,400百万円	22,400百万円
9	額面総額(5)	125,000百万円	25,000百万円
10	表示される科目の区分(6)		
	連結貸借対照表	負債	負債
11	発行日(7)	2020年3月16日	2020年3月16日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	有	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	2025年6月5日：元本全額償還	2030年6月5日：元本全額償還
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	税務事由又は資本事由：元本全額償還	税務事由又は資本事由：元本全額償還
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	初回償還可能日以降の各利払日	初回償還可能日以降の各利払日
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別(11)	固定から変動	固定から変動
18	配当率又は利率(12)	2020年3月16日の翌日から2025年6月5日まで：年1.20/パーセント 2025年6月5日の翌日以降：6か月ユーロ円LIBOR+1.40/パーセント	2020年3月16日の翌日から2030年6月5日まで：年1.39/パーセント 2030年6月5日の翌日以降：6か月ユーロ円LIBOR+1.50/パーセント
19	配当等停止条項の有無(13)	有	有
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(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)	—	—

2021年3月末		
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—
34	その概要	—
34a	劣後性の手段 (23)	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	JP350220AL30	JP350220BL39
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い(2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	その他Tier1資本に係る基礎項目の額	その他Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	その他Tier1資本に係る基礎項目の額	その他Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者(3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	第1回任意償還条項付無担保永久社債(債務免除特約および劣後特約付)	第2回任意償還条項付無担保永久社債(債務免除特約および劣後特約付)
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額(4)		
	連結自己資本規制比率	124,200百万円	24,900百万円
9	額面総額(5)	125,000百万円	25,000百万円
10	表示される科目の区分(6)		
	連結貸借対照表	負債	負債
11	発行日(7)	2020年3月16日	2020年3月16日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	有	有
15	初回償還可能日及びその償還金額(8)	2025年6月5日：元本全額償還	2030年6月5日：元本全額償還
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額(9)	税務事由又は資本事由：元本全額償還	税務事由又は資本事由：元本全額償還
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要(10)	初回償還可能日以降の各利払日	初回償還可能日以降の各利払日
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別(11)	固定から変動	固定から変動
18	配当率又は利率(12)	2020年3月16日の翌日から2025年6月5日まで：年1.20/パーセント 2025年6月5日の翌日以降：6か月ユーロ円LIBOR+1.40/パーセント	2020年3月16日の翌日から2030年6月5日まで：年1.39/パーセント 2030年6月5日の翌日以降：6か月ユーロ円LIBOR+1.50/パーセント
19	配当等停止条項の有無(13)	有	有
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無(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)	—	—

2020年3月末			
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	有	有
31	元本の削減が生じる場合 (20)	・当社が報告又は公表する連結普通株式等Tier1比率が5.125%を下回った場合 ・内閣総理大臣が当社について、預金保険法第126条の2第1項第2号に定める措置である特定第二号措置を講ずる必要がある旨の認定を行った場合 ・当社について倒産手続の開始の決定等がなされた場合	・当社が報告又は公表する連結普通株式等Tier1比率が5.125%を下回った場合 ・内閣総理大臣が当社について、預金保険法第126条の2第1項第2号に定める措置である特定第二号措置を講ずる必要がある旨の認定を行った場合 ・当社について倒産手続の開始の決定等がなされた場合
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	全部削減又は一部削減	全部削減又は一部削減
33	元本回復特約の有無 (22)	有	有
34	その概要	元金回復がなされた直後においても十分に高い水準の連結普通株式等Tier1比率が維持されることについて、あらかじめ金融庁その他の監督当局の確認を受けたうえで、当社が元金の支払義務の免除の効力を将来に向かって消滅させることを決定する場合	元金回復がなされた直後においても十分に高い水準の連結普通株式等Tier1比率が維持されることについて、あらかじめ金融庁その他の監督当局の確認を受けたうえで、当社が元金の支払義務の免除の効力を将来に向かって消滅させることを決定する場合
34a	劣後性の手段 (23)	契約上の劣後	契約上の劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

2021年3月末			
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	有	有
31	元本の削減が生じる場合 (20)	・当社が報告又は公表する連結普通株式等Tier1比率が5.125%を下回った場合 ・内閣総理大臣が当社について、預金保険法第126条の2第1項第2号に定める措置である特定第二号措置を講ずる必要がある旨の認定を行った場合 ・当社について倒産手続の開始の決定等がなされた場合	・当社が報告又は公表する連結普通株式等Tier1比率が5.125%を下回った場合 ・内閣総理大臣が当社について、預金保険法第126条の2第1項第2号に定める措置である特定第二号措置を講ずる必要がある旨の認定を行った場合 ・当社について倒産手続の開始の決定等がなされた場合
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	全部削減又は一部削減	全部削減又は一部削減
33	元本回復特約の有無 (22)	有	有
34	その概要	元金回復がなされた直後においても十分に高い水準の連結普通株式等Tier1比率が維持されることについて、あらかじめ金融庁その他の監督当局の確認を受けたうえで、当社が元金の支払義務の免除の効力を将来に向かって消滅させることを決定する場合	元金回復がなされた直後においても十分に高い水準の連結普通株式等Tier1比率が維持されることについて、あらかじめ金融庁その他の監督当局の確認を受けたうえで、当社が元金の支払義務の免除の効力を将来に向かって消滅させることを決定する場合
34a	劣後性の手段 (23)	契約上の劣後	契約上の劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後の内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

2020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

(単位：百万円、%、件)			
項目	当最終指定親会社四半期		
適格流動資産	(1)		
1 適格流動資産の合計額		2,351,036	
資金流出額	(2)	資金流出率を資金流出率を 乗じる前の額乗じた後の額	
2 リテール無担保資金調達に係る資金流出額		2,035,827	203,582
3 うち、安定預金の額		—	—
4 うち、準安定預金の額		2,035,827	203,582
5 ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額		2,724,293	1,453,521
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		2,622,463	1,351,691
8 うち、負債性有価証券の額		101,829	101,829
9 有担保資金調達等に係る資金流出額		8,055,267	327,332
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		268,302	268,302
11 うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額		252,644	252,644
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		15,658	15,658
14 資金提供義務等に基づく資金流出額		5,094,097	1,064,649
15 偶発事象に係る資金流出額		128,326	116,246
16 資金流出合計額		3,433,636	
資金流入額	(3)	資金流入率を資金流入率を 乗じる前の額乗じた後の額	
17 有担保資金運用等に係る資金流入額		6,329,180	167,623
18 貸付金等の回収に係る資金流入額		524,299	442,871
19 その他資金流入額		4,870,526	1,264,359
20 資金流入合計額		1,874,854	
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		2,351,036	
22 純資金流出額		1,560,663	
23 連結流動性カバレッジ比率		150.6%	
24 平均値計算用データ数		58	

(単位：百万円、%、件)			
項目	前最終指定親会社四半期		
適格流動資産	(1)		
1 適格流動資産の合計額		2,356,156	
資金流出額	(2)	資金流出率を資金流出率を 乗じる前の額乗じた後の額	
2 リテール無担保資金調達に係る資金流出額		1,933,894	193,389
3 うち、安定預金の額		—	—
4 うち、準安定預金の額		1,933,894	193,389
5 ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額		2,662,441	1,385,836
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		2,569,511	1,292,906
8 うち、負債性有価証券の額		92,929	92,929
9 有担保資金調達等に係る資金流出額		7,265,222	376,008
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		244,561	244,561
11 うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額		233,592	233,592
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		10,969	10,969
14 資金提供義務等に基づく資金流出額		4,995,553	948,675
15 偶発事象に係る資金流出額		118,893	108,102
16 資金流出合計額		3,256,574	
資金流入額	(3)	資金流入率を資金流入率を 乗じる前の額乗じた後の額	
17 有担保資金運用等に係る資金流入額		5,670,846	156,230
18 貸付金等の回収に係る資金流入額		427,925	379,244
19 その他資金流入額		4,419,152	985,198
20 資金流入合計額		1,520,673	
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		2,356,156	
22 純資金流出額		1,735,901	
23 連結流動性カバレッジ比率		135.7%	
24 平均値計算用データ数		62	

2021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

(単位：百万円、%、件)			
項目	当最終指定親会社四半期		
適格流動資産	(1)		
1 適格流動資産の合計額		2,760,821	
資金流出額	(2)	資金流出率を資金流出率を 乗じる前の額乗じた後の額	
2 リテール無担保資金調達に係る資金流出額		2,169,136	216,913
3 うち、安定預金の額		—	—
4 うち、準安定預金の額		2,169,136	216,913
5 ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額		2,956,993	1,617,742
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		2,861,814	1,522,563
8 うち、負債性有価証券の額		95,178	95,178
9 有担保資金調達等に係る資金流出額		8,344,352	269,574
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		269,222	269,222
11 うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額		253,669	253,669
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		15,553	15,553
14 資金提供義務等に基づく資金流出額		5,664,248	1,029,948
15 偶発事象に係る資金流出額		147,277	135,170
16 資金流出合計額		3,538,572	
資金流入額	(3)	資金流入率を資金流入率を 乗じる前の額乗じた後の額	
17 有担保資金運用等に係る資金流入額		6,675,874	159,095
18 貸付金等の回収に係る資金流入額		559,774	480,489
19 その他資金流入額		5,181,506	1,186,557
20 資金流入合計額		1,826,142	
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		2,760,821	
22 純資金流出額		1,712,430	
23 連結流動性カバレッジ比率		161.2%	
24 平均値計算用データ数		60	

(単位：百万円、%、件)			
項目	前最終指定親会社四半期		
適格流動資産	(1)		
1 適格流動資産の合計額		2,832,922	
資金流出額	(2)	資金流出率を資金流出率を 乗じる前の額乗じた後の額	
2 リテール無担保資金調達に係る資金流出額		2,003,263	206,748
3 うち、安定預金の額		—	—
4 うち、準安定預金の額		2,003,263	206,748
5 ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額		2,657,048	1,504,326
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		2,529,079	1,372,178
8 うち、負債性有価証券の額		127,969	132,147
9 有担保資金調達等に係る資金流出額		7,603,460	274,732
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		238,982	246,842
11 うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額		225,342	232,803
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		13,640	14,039
14 資金提供義務等に基づく資金流出額		5,178,789	1,087,140
15 偶発事象に係る資金流出額		141,136	129,244
16 資金流出合計額		3,449,034	
資金流入額	(3)	資金流入率を資金流入率を 乗じる前の額乗じた後の額	
17 有担保資金運用等に係る資金流入額		5,975,193	150,395
18 貸付金等の回収に係る資金流入額		526,538	471,151
19 その他資金流入額		4,685,286	1,143,532
20 資金流入合計額		1,765,079	
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		2,832,922	
22 純資金流出額		1,683,954	
23 連結流動性カバレッジ比率		168.2%	
24 平均値計算用データ数		63	

2020年3月末

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号		2020年 3月末	2019年 12月末	2019年 9月末	2019年 6月末	2019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	2,351,036	2,356,156	2,662,299	2,674,229	2,528,417
16	純資金流出額	1,560,663	1,735,901	1,878,549	1,835,406	1,786,074
17	連結流動性カバレ ッジ比率	150.6%	135.7%	141.7%	145.7%	141.5%

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51億20百万円減の2兆3,510億36百万円となりました。ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額が同676億85百万円増の1兆4,535億21百万円、資金提供義務等に基づく資金流出額が同1,159億74百万円増の1兆646億49百万円、その他資金流入額が同2,791億61百万円増の1兆2,643億59百万円となり、純資金流出額は同1,752億38百万円減の1兆5,606億63百万円となりました。

その結果、連結流動性カバレッジ比率は同14.9%増の150.6%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

開示が必要な重要事項はございません。

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。

2021年3月末

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号		2021年 3月末	2020年 12月末	2020年 9月末	2020年 6月末	2020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	2,760,821	2,832,922	2,716,787	2,538,362	2,351,036
16	純資金流出額	1,712,430	1,683,954	1,639,682	1,401,920	1,560,663
17	連結流動性カバレ ッジ比率	161.2%	168.2%	165.6%	181.0%	150.6%

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721億1百万円減の2兆7,608億21百万円となりました。ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額が同1,134億16百万円増の1兆6,177億42百万円、資金提供義務等に基づく資金流出額が同571億92百万円減の1兆299億48百万円、その他資金流入額が同430億25百万円増の1兆1,865億57百万円となり、純資金流出額は同284億76百万円増の1兆7,124億30百万円となりました。

その結果、連結流動性カバレッジ比率は同7.0%減の161.2%となり、過去2年間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

開示が必要な重要事項はございません。

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。

2020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) リスクアパタイト指標

短期指標としての連結流動性カパ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パ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。

2021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) リスクアパタイト指標

短期指標としての連結流動性カパ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パ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。

対象従業員等については、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. 26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ようとする者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・マーケティング)・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4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 (2020年4月～2021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

当社は、会社法の定めるところにより、報酬委員会が「取締役及び執行役の報酬の内容の決定に関する方針」を決定しています。

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、報酬委員会において決定しており、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、役割に応じた金銭による月例の固定報酬とする。

○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し、毎年一定の時期に支給する。
- ・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。
- ・執行役を兼務しない取締役に対しては、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非金銭報酬として毎年一定の時期に付与する。
- ・社外取締役に対しては、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

当期において報酬体系の設計・運用について重要な変更はありません。

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・一部門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おりません。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 2020年4月1日 至 2021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	固定報酬	対象役員及び対象従業者等の数	25	2
2		固定報酬の総額（3+5+7）	1,184	78
3		うち、現金報酬額	1,184	78
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	変動報酬	対象役員及び対象従業者等の数	18	2
10		変動報酬の総額（11+13+15）	1,000	872
11		うち、現金報酬額	783	872
12		11のうち、繰延額	0	0
13		うち、株式報酬額又は株式連動型報酬額	216	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	退職慰労金	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	その他の報酬	対象役員及び対象従業者等の数	0	0
21		その他の報酬の総額	0	0
22		うち、繰延額	0	0
23	報酬等の総額（2+10+18+21）		2,203	951

(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。

(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	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
総額		0	0	0	0	0

大和証券 会社概要

105 大和証券概要・沿革

106 組織図

107 役員・政令で定める使用人一覧

108 その他コーポレート情報

129 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

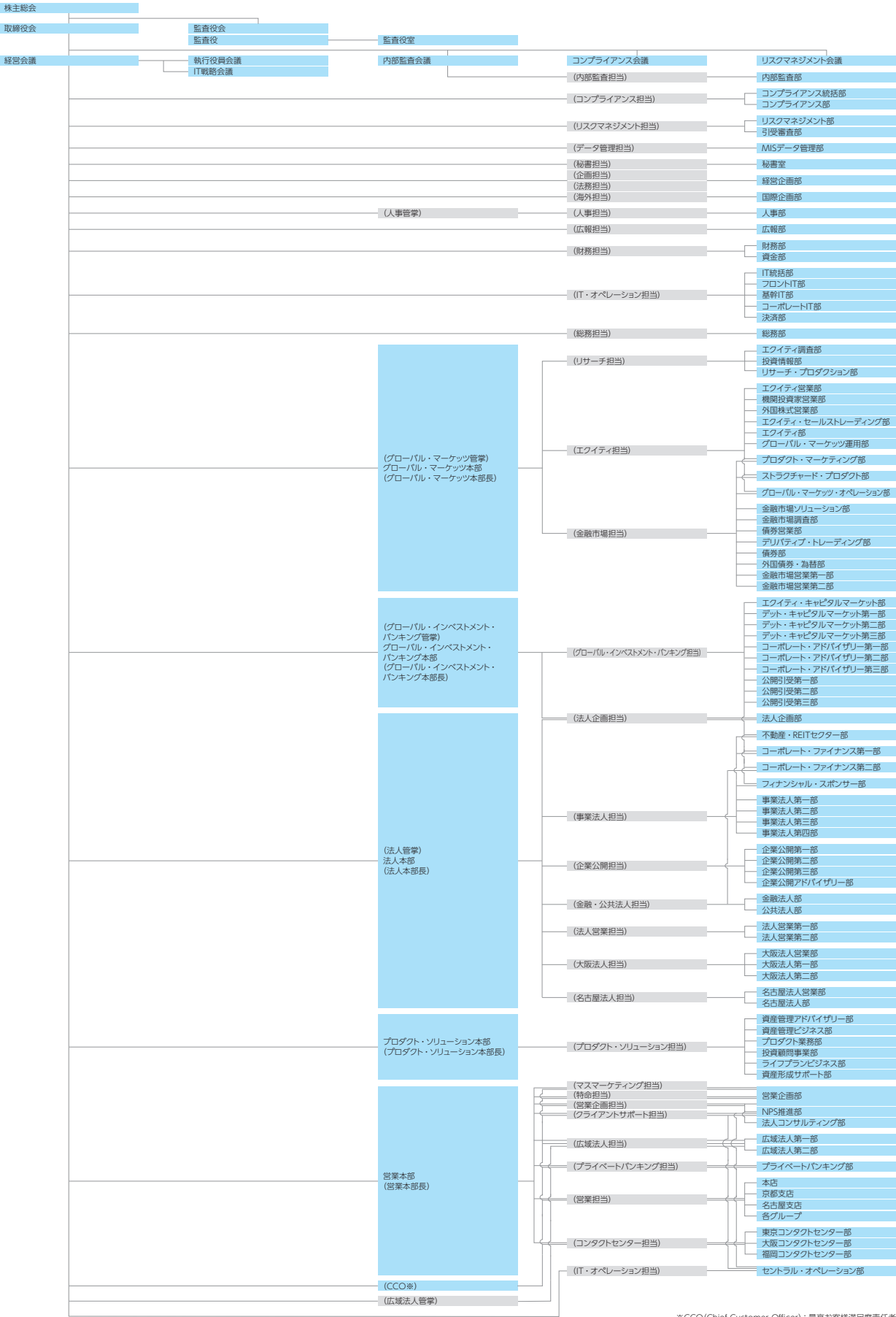
登録年月日(登録番号)

2007年9月30日(関東財務局長(金商)第108号)

会社の沿革(2021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。
2020年10月	「大和プロパティ(株)」及び「大和オフィスサービス(株)」を吸収合併。

組織図 (2021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(2021年7月1日)

取締役

取締役会長 日比野 隆司	専務取締役 原 宏
代表取締役社長 中田 誠司	専務取締役 金子 好久
代表取締役副社長 松井 敏浩	専務取締役 在原 淳一
代表取締役副社長 高橋 一夫	専務取締役 大塚 祥史
代表取締役副社長 田代 桂子	専務取締役 藤岡 智男
代表取締役副社長 小松 幹太	専務取締役 白川 香名
専務取締役 小林 昭広	専務取締役 村瀬 智之
専務取締役 松本 好仙	専務取締役 姜 昇浩
専務取締役 下村 直人	専務取締役 田所 俊弥
専務取締役 新妻 信介	専務取締役 櫻井 裕子
専務取締役 荻野 明彦	専務取締役 池田 弘樹
専務取締役 岩崎 靖史	専務取締役 柳沢 志向
代表取締役 専務取締役 望月 篤	

監査役

監査役
白鳥 賢一

監査役
花岡 幸子

監査役
川島 博政

監査役
大林 宏

執行役員

常務執行役員 城川 博孝	執行役員 田中 義明	執行役員 藤澤 正博
常務執行役員 佐野 径	執行役員 成枝 隆明	執行役員 村田 勝安
常務執行役員 関根 太	執行役員 竹内 由紀子	執行役員 丹羽 功
常務執行役員 辻 朋紀	執行役員 若山 朋秀	執行役員 森元 裕介
常務執行役員 佐藤 英二	執行役員 田中 稔介	執行役員 大橋 義則
常務執行役員 山本 徹	執行役員 山田 孝志	執行役員 吉田 光太郎
常務執行役員 芹澤 潤一	執行役員 板屋 篤	執行役員 成毛 豊文
常務執行役員 辻岡 功	執行役員 上野 賢一	執行役員 田澤 健一
常務執行役員 小林 奨	執行役員 前川 克己	執行役員 小林 雄道
執行役員 高橋 努務	執行役員 中澤 嘉謙	

政令で定める使用人の氏名(2021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	望月 篤
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		藤井 和則

(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	投資顧問事業部 マネーマネージャー 近藤 直樹 星 宏明 松永 修治 榎本 直之 似内 正通 大平 秀延 高橋 健文 相川 章子 内山 涼平 久保田 哲平 網倉 康宏 米長 忍 諏訪 英生 鈴木 央要 深澤 幸太	投資顧問事業部 アセット・アドバイザー 渡邊 光治 釜本 征和 河田 秀憲 牧村 篤志
常務執行役員 プロダクト・ソリューション担当 佐野 径		
常務取締役 リサーチ担当 藤岡 智男		
参与 リサーチ担当 藤倉 敬		
参与 リサーチ担当 成瀬 順也		
エクイティ調査部長 市川 元久		
投資情報部長 高橋 卓也		
投資顧問事業部長 小野澤 潤		

(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
常務執行役員	プロダクト・ソリューション担当	佐野 径

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
 一般社団法人 日本STO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

	2019年 3月期末	2020年 3月期末	2021年 3月期末
役員	23名	28名	29名
使用人	9,195名	9,186名	8,962名
合計	9,218名	9,214名	8,991名
内、日本証券業協会に登録している外務員	8,951名	8,934名	8,593名
内、金融先物取引業協会に登録している外務員	1,130名	1,155名	1,264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

(2021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(2020年4月1日から2021年3月31日までの12ヶ月間)の純営業収益は、3,013億円(対前事業年度増減率11.7%増)となりました。販売費・一般管理費は2,357億円(同2.0%減)となりました。経常利益は662億円(同122.5%増)、法人税など控除後の当期純利益は413億円(同255.4%増)となりました。

(1) 受入手数料

受入手数料合計は1,861億円(同4.7%増)となりました。

① 委託手数料

委託手数料は583億円(同41.5%増)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338億円(同20.6%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190億円(同17.4%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750億円(同12.2%減)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1,025億円(同33.7%増)となりました。内訳は、株券等トレーディング損575億円(同43.7%増)、債券等トレーディング損益333億円(同11.9%減)、その他トレーディング損益117億円となっております。

(3) 金融収支

金融収益は263億円(同40.1%減)、金融費用は137億円(同52.1%減)となり、金融収支は125億円(同17.6%減)となりました。

(4) 販売費・一般管理費

人件費は968億円(同1.8%増)、事務費は471億円(同0.3%減)、取引関係費は357億円(同20.0%減)、不動産関係費は241億円(同3.2%減)、減価償却費は230億円(同14.6%増)となり、販売費・一般管理費合計は2,357億円(同2.0%減)となりました。

2. 財政状態に関する分析

資産合計は13兆974億円(対前事業年度末比1兆1,171億円増)、負債合計は12兆3,030億円(同1兆676億円増)、純資産合計は7,944億円(同494億円増)となりました。

内部管理の状況の概要(2021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コンプライアンス会議

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、コンプライアンス会議を設置しています。

コンプライアンス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、各営業店では毎月営業店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、ライン部室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、マネー・ロン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) 内部監査態勢

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)

	2019年3月期	2020年3月期	2021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	332,374	298,652	315,179
(受入手数料)	185,741	177,833	186,197
((委託手数料))	43,043	41,274	58,321
((引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料))	36,563	28,044	33,830
((募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料))	25,840	23,025	19,004
((その他の受入手数料))	80,295	85,488	75,040
(トレーディング損益)	89,168	76,735	102,596
((株券等))	39,847	40,029	57,590
((債券等))	42,519	37,852	33,305
((その他))	6,802	△1,146	11,700
純営業収益	292,828	269,872	301,399
経常利益	53,710	29,788	66,283
当期純利益	38,297	11,646	41,393

※従来、ファンドラップに係る取引等管理手数料は「受入手数料」の「募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱手数料」に含めて計上しておりましたが、2015年3月期より「受入手数料」の「その他の受入手数料」に含めております。

(2) 有価証券引受・売買等の状況

① 株券の売買高の推移

		2019年3月期	2020年3月期	2021年3月期
自己	株数	21,289百万株	16,807百万株	10,953百万株
	金額	41,343,058百万円	31,933,263百万円	22,985,694百万円
委託	株数	21,177百万株	19,386百万株	22,605百万株
	金額	41,268,562百万円	36,575,053百万円	41,494,299百万円
計	株数	42,467百万株	36,194百万株	33,558百万株
	金額	82,611,620百万円	68,508,317百万円	64,479,994百万円

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
2021年3月期	株券	千株	千株	千株	千株	千株	千株	千株
		321,673	321,673	—	0	0	35	—
		百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円
		527,864	527,864	—	0	0	1,777	—
	国債証券	—	—	—	438,682	—	—	—
	地方債証券	10,061,215	—	—	1,006,125	—	—	—
	特殊債券	1,503,643	0	—	1,511,270	—	—	—
	社債券	3,802,100	122,106	—	2,407,500	97,413	1,101,901	—
	受益証券	—	—	—	3,585,930	—	374,772	—
	その他	33,388	—	—	—	—	—	—
	合計	6,873,122	649,970	—	8,949,508	97,413	1,478,450	—
2020年3月期	株券	千株	千株	千株	千株	千株	千株	千株
		111,520	111,520	—	0	0	25	—
		百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円
		292,222	292,222	—	0	0	2,994	—
	国債証券	—	—	—	1,087,550	—	—	—
	地方債証券	983,948	—	—	983,337	—	—	—
	特殊債券	1,187,146	—	—	1,165,010	—	11,000	—
	社債券	3,842,850	99,018	—	3,135,520	75,692	826,494	—
	受益証券	—	—	—	3,950,696	—	359,216	—
	その他	115,882	—	—	—	—	—	—
	合計	6,404,048	391,240	—	10,322,113	75,692	1,199,704	—
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	2	—
		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	4,620	—
	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	—

(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)

	2019年 3月期	2020年 3月期	2021年 3月期
保険募集業務に係る 手数料	2,820	1,336	755

② 証券担保ローンの取扱残高(貸付残高)

(単位：百万円)

	2019年 3月期	2020年 3月期	2021年 3月期
証券担保ローンの 取扱残高	116,995	192,351	252,252

(4) 自己資本規制比率の状況

(単位：％、百万円)

	2019年 3月期	2020年 3月期	2021年 3月期
基本的項目(A)	770,031	743,380	792,528
補充的項目	その他有価証券評価差額金(評価益)等	2,249	1,547
	金融商品取引責任準備金等	3,924	3,904
	一般貸倒引当金	110	149
	長期劣後債務	51,180	50,000
	短期劣後債務	5,245	5,900
計(B)	62,710	61,501	55,653
控除資産(C)	124,353	130,389	168,941
固定化されていない自己資本((A)+(B)-(C))(D)	708,388	674,492	679,240
リスク相当額	市場リスク相当額	88,684	87,350
	取引先リスク相当額	51,290	57,580
	基礎的リスク相当額	64,385	61,370
	計(E)	204,359	206,301
自己資本規制比率(D)/(E)×100	346.6	326.9	364.6

財務諸表

貸借対照表

(単位：百万円)

科 目	2020年3月期 (2020年3月31日現在)	2021年3月期 (2021年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産	11,852,547	12,931,086
現金・預金	981,808	1,495,682
預託金	383,574	426,579
トレーディング商品	5,827,227	5,073,676
商品有価証券等	2,141,756	2,665,656
デリバティブ取引	3,685,470	2,408,020
約定見返勘定	—	6,513
信用取引資産	112,046	156,604
信用取引貸付金	102,893	146,648
信用取引借証券担保金	9,152	9,956
有価証券担保貸付金	3,370,605	4,692,989
借入有価証券担保金	1,467,240	2,259,720
現先取引貸付金	1,903,364	2,433,268
立替金	25,392	19,927
短期差入保証金	596,135	549,259
短期貸付金	524,891	469,281
未収収益	26,282	23,727
その他の流動資産	4,739	16,926
貸倒引当金	△156	△82
固定資産	127,777	166,359
有形固定資産	8,376	47,297
建物	2,444	29,091
器具備品	5,930	5,714
土地	0	12,070
その他	—	420
無形固定資産	76,908	74,472
ソフトウェア	53,286	57,773
その他	23,621	16,698
投資その他の資産	42,492	44,589
投資有価証券	7,918	7,636
関係会社株式	1,135	1,110
長期貸付金	4,874	4,874
長期差入保証金	15,067	15,782
繰延税金資産	11,001	12,190
その他	5,328	5,830
貸倒引当金	△2,831	△2,836
資産合計	11,980,325	13,097,445

科 目	2020年3月期 (2020年3月31日現在)	2021年3月期 (2021年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債	9,903,729	10,859,247
トレーディング商品	4,264,029	3,464,269
商品有価証券等	768,607	1,164,998
デリバティブ取引	3,495,422	2,299,270
約定見返勘定	126,831	—
信用取引負債	58,617	63,118
信用取引借入金	3,435	3,292
信用取引貸証券受入金	55,182	59,825
有価証券担保借入金	3,200,853	4,843,328
有価証券貸借取引受入金	301,333	853,047
現先取引借入金	2,899,519	3,990,281
預り金	258,484	347,481
受入保証金	407,695	359,537
短期借入金	1,165,588	1,288,777
コマーシャル・ペーパー	199,900	265,000
1年内償還予定の社債	149,355	157,167
未払金	18,867	30,080
未払費用	15,224	13,975
未払法人税等	1,578	5,048
賞与引当金	10,142	13,934
その他の流動負債	26,559	7,527
固定負債	1,327,763	1,440,094
社債	596,071	674,445
長期借入金	689,637	715,043
退職給付引当金	32,096	32,576
訴訟損失引当金	1,570	1,809
その他の固定負債	8,387	16,219
特別法上の準備金	3,904	3,687
金融商品取引責任準備金	3,904	3,687
負債合計	11,235,397	12,303,030
(純資産の部)		
株主資本	743,380	792,528
資本金	100,000	100,000
資本剰余金	349,920	352,358
資本準備金	50,010	50,010
その他資本剰余金	299,910	302,348
利益剰余金	293,460	340,170
利益準備金	2,430	2,430
その他利益剰余金	291,030	337,740
繰越利益剰余金	291,030	337,740
評価・換算差額等	1,547	1,886
その他有価証券評価差額金	1,547	1,886
純資産合計	744,927	794,415
負債及び純資産合計	11,980,325	13,097,445

損益計算書

(単位：百万円)

科 目	2020年3月期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	2021年3月期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益	298,652	315,179
受入手数料	177,833	186,197
トレーディング損益	76,735	102,596
金融収益	44,083	26,385
金融費用	28,780	13,780
純営業収益	269,872	301,399
販売費・一般管理費	240,566	235,750
営業利益	29,305	65,648
営業外収益	782	3,840
営業外費用	299	3,205
経常利益	29,788	66,283

(右上に続く)

(単位：百万円)

科 目	2020年3月期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	2021年3月期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
特別利益	392	305
投資有価証券売却益	163	88
金融商品取引責任準備金戻入	19	217
移転関連費用戻入益	208	—
特別損失	12,748	4,931
固定資産除売却損	46	317
減損損失	—	2,231
投資有価証券評価損	—	3
構造改革関連費用	12,702	2,377
税引前当期純利益	17,433	61,656
法人税、住民税及び事業税	8,563	21,007
法人税等調整額	△2,776	△744
法人税等合計	5,786	20,262
当期純利益	11,646	41,393

株主資本等変動計算書

2021年3月期 (自 2020年4月1日 至 2021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			利益準備金	利益剰余金		株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計				
2020年4月1日残高	100,000	50,010	299,910	349,920	2,430	291,030	293,460	743,380	1,547	1,547	744,927
事業年度中の変動額											
剰余金の配当						△11,645	△11,645	△11,645			△11,645
当期純利益						41,393	41,393	41,393			41,393
企業結合による増加			2,438	2,438		16,961	16,961	19,400			19,400
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額(純額)									339	339	339
事業年度中の変動額合計	－	－	2,438	2,438	－	46,709	46,709	49,148	339	339	49,487
2021年3月31日残高	100,000	50,010	302,348	352,358	2,430	337,740	340,170	792,528	1,886	1,886	794,415

2020年3月期 (自 2019年4月1日 至 2020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	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計				
2019年4月1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
事業年度中の変動額											
剰余金の配当	－	－	－	－	－	△38,297	△38,297	△38,297	－	－	△38,297
当期純利益	－	－	－	－	－	11,646	11,646	11,646	－	－	11,646
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額（純額）	－	－	－	－	－	－	－	－	△702	△702	△702
事業年度中の変動額合計	－	－	－	－	－	△26,651	△26,651	△26,651	△702	△702	△27,353
2020年3月31日残高	100,000	50,010	299,910	349,920	2,430	291,030	293,460	743,380	1,547	1,547	744,927

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。

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、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

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。

(4) 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(実務対応報告第39号 2020年3月31日)第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日)第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

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。

なお、デリバティブ取引については、特定の市場リスク及び特定の信用リスクの評価に関して、金融資産及び金融負債を相殺した後の正味の資産又は負債を基礎として、当該金融資産及び金融負債のグループを単位とした時価を算定しております。

(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
市場価格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)、市場価格のない株式等(非上場株式等)並びに組合出資金等については、移動平均法による原価法で計上しております。

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。

(4) 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(実務対応報告第39号 2020年3月31日)第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日)第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

2020年3月期	2021年3月期
会計方針の変更に関する注記	
該当事項はありません。	「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。)等を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日)第44～2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用しております。これによる計算書類に与える影響はありません。 また、「金融商品に関する注記」において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。
表示方法の変更	
該当事項はありません。	「会計上の見積りの開示に関する会計基準」(企業会計基準第31号 2020年3月31日)を当事業年度の年度末に係る計算書類から適用し、計算書類に重要な会計上の見積りに関する注記を記載しております。
会計上の見積りに関する注記	
該当事項はありません。	会計上の見積りにより当事業年度に係る計算書類にその額を計上した項目であって、翌事業年度に係る計算書類に重要な影響を及ぼす可能性があるものは、次のとおりです。 (トレーディング商品に属するレベル3のデリバティブ取引に係る評価) (1)当事業年度に係る計算書類に計上した額 トレーディング商品に属するデリバティブ取引のうち、レベル3に区分されている資産は470億円、負債は198億円であり、市場で観察できないインプットを使用して時価を算定していることから見積りの不確実性があります。 (2)識別した項目に係る重要な会計上の見積りの内容に関する理解に資する情報 トレーディング商品に属するデリバティブ取引の時価は、リスク中立測定度下での期待キャッシュ・フロー・ディスカウント・モデルにより算定しております。 この時価算定の会計上の見積りにおける主要な仮定は価格算定モデルに用いるインプットであります。価格算定モデルには、金利、為替レート、株価、ボラティリティ、相関係数などの様々なインプットを使用しており、特に、レベル3のデリバティブ取引の時価の算定には、長期のスワップ・レート、長期の通貨ベース、長期の株価ボラティリティ、長期のクレジット・スプレッド及び相関係数といった市場で観察できないインプットを使用しております。 これらの内容は、「金融商品に関する注記(注)1 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明」に記載しております。 市場環境の変化等による主要な仮定の変化が、トレーディング商品の評価額に重要な影響を及ぼす可能性があります。重要な観察できないインプットを変化させた場合の時価に対する影響については、「金融商品に関する注記(注)2 時価で貸借対照表に計上している金融商品のうちレベル3の時価に関する情報」に記載しております。

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	530,220百万円
(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35,917百万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	278,357百万円
(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	300,522百万円
現先取引で売り付けた有価証券	2,619,625百万円
その他	354,559百万円

(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	1,488,682百万円
現先取引で買い付けた有価証券	1,593,216百万円
その他	172,785百万円

3. 有形固定資産の減価償却累計額

17,821百万円

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	316
従業員	借入金	23
計		340

5. 関係会社に対する金銭債権債務

短期金銭債権	35,321百万円
長期金銭債権	1,362百万円
短期金銭債務	315,011百万円
長期金銭債務	336,037百万円

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	417,559百万円
(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28,967百万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	100,100百万円
(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	851,630百万円
現先取引で売り付けた有価証券	3,524,972百万円
その他	365,364百万円

(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	2,250,216百万円
現先取引で買い付けた有価証券	1,954,353百万円
その他	259,202百万円

3. 有形固定資産の減価償却累計額

71,239百万円

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	376
従業員	借入金	15
計		391

5. 関係会社に対する金銭債権債務

短期金銭債権	52,306百万円
長期金銭債権	952百万円
短期金銭債務	167,617百万円
長期金銭債務	380,921百万円

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	2,009百万円
トレーディング損益	△346百万円
金融収益	△9百万円
金融費用	9,286百万円
販売費・一般管理費	292百万円

(2) 営業取引以外の取引

94百万円

関係会社との取引高

(1) 営業取引

受入手数料	448百万円
トレーディング損益	556百万円
金融収益	12百万円
金融費用	6,024百万円
販売費・一般管理費	458百万円

(2) 営業取引以外の取引

1,505百万円

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

該当する事項はありません。

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)
2019年6月18日 定時株主総会	普通株式	38,297	47,269
計		38,297	

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、次の通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 11,645百万円

(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
該当する事項はありません。

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

該当する事項はありません。

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

該当する事項はありません。

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)
2020年6月18日 定時株主総会	普通株式	11,645	14,374
計		11,645	14,374

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、次の通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 41,393百万円

(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
該当する事項はありません。

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

該当する事項はありません。

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の主な原因別の内訳

繰延税金資産	
退職給付引当金	9,842百万円
賞与引当金	2,994
資産除去債務	2,552
商品有価証券・デリバティブ	1,824
金融商品取引責任準備金	1,195
減損損失	899
投資有価証券評価損	641
事業税・事業所税	499
減価償却超過額	348
その他	6,546
繰延税金資産 小計	27,345
評価性引当額	△14,978
繰延税金資産 合計	12,367
繰延税金負債	
資産除去債務に対応する除去費用	740
その他有価証券評価差額金	626
その他	0
繰延税金負債 合計	1,366
繰延税金資産の純額	11,001

繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

繰延税金資産	
減損損失	12,013百万円
退職給付引当金	9,992
賞与引当金	4,067
資産除去債務	2,578
商品有価証券等・デリバティブ	2,007
事業税・事業所税	1,179
金融商品取引責任準備金	1,129
投資有価証券評価損	700
減価償却超過額	330
その他	6,771
繰延税金資産 小計	40,770
評価性引当額	△27,050
繰延税金資産 合計	13,720
繰延税金負債	
資産除去債務に対応する除去費用	775
その他有価証券評価差額金	753
その他	0
繰延税金負債 合計	1,529
繰延税金資産の純額	12,190

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、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かつ安定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、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かつ安定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。これらの他、関連するリスクとしてモデルリスクがあります。モデルリスクとは、モデルの開発、実装における誤り、又はモデルの誤用に起因して、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、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こと、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12億円であります。

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。

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こと、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・予算等を勘案したうえで、VaR、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12億円であります。

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施し、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。

(iii) モデルリスクの管理

トレーディング商品の時価評価モデルは、モデルリスク管理体制のもと、検証・承認のプロセスを経てモデルの妥当性を確認したのちに使用されます。また、市場実勢の変化に伴い、不測のモデルリスクが発生することを防止するため、市場動向に合うよう定期的にレビューを行っております。

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、2020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、2020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0.9億円、「長期借入金」の時価が9億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。

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。

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、2021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、2021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0.8億円、「長期借入金」の時価が7億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る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。

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。

2020年3月期

2. 金融商品の時価等に関する事項

2020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	981,808	981,808	—
(2) 預託金	383,574	383,574	—
(3) トレーディング商品			
① 商品有価証券等	2,141,756	2,141,756	—
② デリバティブ取引	3,685,470	3,685,470	—
(4) 信用取引資産			
信用取引貸付金	102,893	102,893	—
信用取引借証券担保金	9,152	9,152	—
(5) 有価証券担保貸付金			
借入有価証券担保金	1,467,240	1,467,240	—
現先取引貸付金	1,903,364	1,903,364	—
(6) 短期差入保証金	596,135	596,135	—
(7) 短期貸付金	524,891	524,891	—
(8) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	2,880	2,880	—
資産計	11,799,169	11,799,169	—
(1) トレーディング商品			
① 商品有価証券等	768,607	768,607	—
② デリバティブ取引	3,495,422	3,495,422	—
(2) 約定見返勘定	126,831	126,831	—
(3) 信用取引負債			
信用取引借入金	3,435	3,435	—
信用取引貸証券受入金	55,182	55,182	—
(4) 有価証券担保借入金			
有価証券貸借取引受入金	301,333	301,333	—
現先取引借入金	2,899,519	2,899,519	—
(5) 預り金	258,484	258,484	—
(6) 受入保証金	407,695	407,695	—
(7) 短期借入金	1,165,588	1,165,588	—
(8) コマーシャル・ペーパー	199,900	199,900	—
(9) 1年内償還予定の社債	149,355	149,355	—
(10) 社債	596,071	596,384	△312
(11) 長期借入金	689,637	695,561	△5,924
負債計	11,117,066	11,123,303	△6,237

（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

2021年3月期

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

事業年度末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、企業会計基準適用指針第31号「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（以下、「時価算定適用指針」という。）第26項に従い経過措置を適用した投資信託、市場価格のない株式等及び時価算定適用指針第27項に従い経過措置を適用した組合出資金等については、表には含めておりません（（1）、（注）3に記載のとおりであります）。

金融商品の時価を、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価： 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価： 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価： 観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

（1）時価で貸借対照表に計上している金融商品

（単位：百万円）

	時価			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1) トレーディング商品				
① 商品有価証券等				
株券・ワラント	92,502	498	84	93,085
国債・地方債等	1,533,942	261,692	—	1,795,635
一般事業債	759	320,058	1,305	322,124
外国債券	17,109	216,569	3,489	237,168
その他	—	999	1,261	2,261
② デリバティブ取引				
エクイティ	21,820	157,872	28,822	208,515
金利	896	1,662,199	9,229	1,672,325
通貨	—	502,092	4,119	506,212
クレジット・その他	—	16,137	4,829	20,967
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券				
株券	3,315	—	—	3,315
資産計	1,670,345	3,138,123	53,140	4,861,609
(1) トレーディング商品				
① 商品有価証券等				
株券・ワラント	153,025	2,075	—	155,100
国債・地方債等	971,348	—	—	971,348
外国債券	38,544	—	—	38,544
② デリバティブ取引				
エクイティ	57,592	153,187	8,807	219,588
金利	114	1,601,735	6,032	1,607,882
通貨	—	440,689	249	440,939
クレジット・その他	—	26,067	4,793	30,861
負債計	1,220,625	2,223,755	19,883	3,464,265

「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等」の一部を改正する内閣府令（令和2年3月6日内閣府令第9号）附則第2条第6項の経過措置を適用した投資信託については、上記表には含めておりません。貸借対照表における当該投資信託の金額は、商品有価証券等において資産215,382百万円、負債4百万円であります。

2020年3月期

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。

2021年3月期

(2) 時価で貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品

(単位：百万円)

	時価				貸借対照表	
	レベル1	レベル2	レベル3	合計	計上額	差額
(1) 社債	-	675,123	-	675,123	674,445	△677
(2) 長期借入金	-	720,030	-	720,030	715,043	△4,986
負債計	-	1,395,153	-	1,395,153	1,389,489	△5,664

なお、「現金・預金」「預託金」「約定見返勘定」「有価証券担保貸付金」「有価証券担保借入金」「短期貸付金」「預り金」「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」は、現金であること、または短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似するものであることから、記載を省略しております。また、以下の勘定科目は、その勘定の性質から短期間で決済されるとみなし、時価は帳簿価額と近似していることから、記載を省略しております。

(ア) 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おります。

(イ) 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おります。

(注) 1 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

(1) トレーディング商品

① 商品有価証券等

株式等については、主たる取引所の最終価格又は最終気配値を時価としており、主にレベル1の時価に分類しております。

債券については、主に類似の債券を含めた市場価格(当社店頭、ブローカースクリーン等)または、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を時価としており、一部国債等はレベル1の時価に分類し、それ以外はレベル2の時価に分類しております。ただし、レベル2の時価と分類するのに必要な価格情報が得られない場合はレベル3の時価に分類しております。また、一部債券の時価については、デリバティブ取引と同様に価格算定モデルにより算定しております。観察可能なインプットのみを用いて価格を算定している場合、もしくは観察できないインプットを用いて価格を算定していてもその影響が重要でない場合は、レベル2の時価に分類し、重要な観察できないインプットを用いて価格を算定している場合はレベル3の時価に分類しております。

投資信託については、取引所の最終価格若しくは最終気配値又は基準価額を時価としております。ただし、レベルの分類については、時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、レベルを付していません。

(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	2,981
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	734
その他	1,322

(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。

②デリバティブ取引

上場デリバティブ取引は、主に取引所の清算値価格又は証拠金算定基準価格を時価としており、レベル1の時価に分類しております。ただし、上記価格が得られない場合や取引が頻繁に行われていない場合は、レベル2の時価と分類しております。

店頭デリバティブ取引については、金利スワップ、通貨スワップ、エクイティ・デリバティブ、クレジット・デリバティブといった取引があります。時価の算定においては、市場で一般に用いられるリスク中立測度の仮定のもとでの期待キャッシュ・フローの現在価値を、主に数値積分法、有限差分法及びモンテカルロ法による価格算定モデルにより算定しております。価格算定モデルには、金利、為替レート、株価、ボラティリティ、相関係数などの様々なインプットがあります。観察可能なインプットのみを用いて価格を算定している場合、もしくは観察できないインプットを用いて価格を算定している場合、もしくは観察できないインプットを用いて価格を算定している場合はレベル3の時価に分類しております。市場で観察できないインプットとしては、長期のスワップ・レート、長期の通貨ベースス、長期の株価ボラティリティ、長期のクレジット・スプレッド及び相関係数があります。

なお、店頭デリバティブ取引については、取引相手先及び当社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調整しております。

(2)有価証券及び投資有価証券

株式については、主たる取引所の最終価格又は最終気配値を時価としており、レベル1の時価に分類しております。

(3)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、レベル2の時価に分類しております。市場価格が入手不可能な場合においても、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時価を算定しており、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いることから、レベル2の時価に分類しております。

(4)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時価を算定しており、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いることから、レベル2の時価に分類しております。

(注)2 時価で貸借対照表に計上している金融商品のうちレベル3の時価に関する情報

(1)重要な観察できないインプットに関する定量的情報

区分	評価技法	重要な観察できないインプット	インプットの範囲
デリバティブ取引	リスク中立測度下での期待キャッシュ・フロー・ディスカント・モデル		
金利・為替		スワップ・レート 通貨ベース	△0.1－2.3% △0.8－0.4%
エクイティ		株価ボラティリティ	19.1－22.1%
クレジット・その他		クレジット・スプレッド 相関係数	0.1－4.1% △0.06－0.90

(2) 期首残高から期末残高への調整表、当事業年度の損益に認識した評価損益
レベル3の時価をもって貸借対照表価額とする資産及び負債の内訳及び
期中における変動は以下のとおりであります。

(単位：百万円)

	商品有価証券等 (資産)	デリバティブ取引 (純額)	合計
期首残高	13,334	67,416	80,751
当事業年度の損益			
損益に計上(※2)	487	△13,714	△13,227
購入、売却、発行及び決済			
購入	38,175	2,238	40,414
売却	△43,203	△16	△43,220
発行	—	—	—
決済	—	△13,451	△13,451
レベル3の時価への振替 (※1、※4)	8,117	△1,110	7,006
レベル3の時価からの振替 (※1、※5)	△10,770	△14,245	△25,016
期末残高	6,140	27,116	33,256
当事業年度の損益に計上した額の うち貸借対照表において保有する 金融商品の評価損益(※3)	16	△27,165	△27,149

※1 レベル間の振替は期首時点で認識することとしております。

※2 「商品有価証券等(資産)」、「デリバティブ取引(純額)」に係る損益は、「トレーディング損益」に含まれております。

※3 レベル3金融商品に関しては、観察可能でないインプットのみでなく、観察可能なインプットの変動も評価損益の一因となります。また、レベル3金融商品の多くは、他のレベル(レベル1、2)に分類されている金融商品によって経済的にヘッジされておりますが、当該金融商品の損益については上記の表には含まれておりません。

※4 レベル1もしくはレベル2からレベル3への振替の理由は、一部の有価証券について相場価格が入手不能となったため、または、評価技法へのインプットが観察可能でなくなったためであります。

※5 レベル3からレベル1もしくはレベル2への振替の理由は、一部の有価証券について相場価格が入手可能となったため、または、評価技法へのインプットが観察可能となったためであります。

(3) 時価の評価プロセスの説明

トレーディングを行う部署が保有する金融商品の時価について、当社が定める基本的方針に従って算定及び検証が行われます。算定された結果は、算定に用いたインプットも含めて、トレーディングを行う部署から独立した部署によって検証が行われます。

当社では、時価の算定に用いる価格算定モデルについて承認を行うプロセスに関する指針を定めており、これに従って、価格算定モデルの開発部署から独立した部署がモデル内の仮定及び技法について検証を行います。また、価格算定モデルは観察可能な市場情報や代替可能なモデルとの比較分析等により、市場動向に合わせて調整する体制を構築しています。

(4) 重要な観察できないインプットを変化させた場合の時価に対する影響に関する説明

重要な観察できないインプットとしては、長期のスワップ・レート、長期の通貨ベース、長期の株価ボラティリティ、長期のクレジット・スプレッド及び相関係数があります。時価の算定において、金利の変動は期待キャッシュ・フローや割引率に影響し、クレジット・スプレッドの変動は倒産確率に影響します。ボラティリティについては、ボラティリティが上昇(下落)するとオプション価値が増加(減少)します。相関係数は複数資産間の幅広い組み合わせがあり、水準や変動の方向性もその組み合わせにより大きく異なる可能性があります。

店頭デリバティブ取引の時価は年限毎や通貨毎に与えられる複数のインプットから算定され、市場が変動した場合には、全てのインプットの影響額の合算として時価が増加もしくは減少します。また、各インプット変動の時価への影響は取引毎の商品性によって決まります。レベル3に分類される金融商品の時価の算定に使用する観察可能でないインプットは、各々が必ずしも独立したものではなく、他のインプットとの相関関係が存在する場合があります。こうした関係の多くは、相関係数を通じて捕捉されており、複数資産間の幅広い相関係数の影響により、金融商品の時価が増加または減少します。

2020年3月期

2021年3月期

商品区分ごとに合理的に起こり得る代替的な仮定を用いた場合のレベル3金融商品の時価に対する影響は以下のとおりであり、前記(1)の重要な観測できないインプットの範囲を元に計算しています。

(単位：百万円)

	時価	プラスの時価変動	マイナスの時価変動
デリバティブ	27,116	1,443	1,443

(注)3 当事業年度において、市場価格のない株式等(非上場株式等)並びに組合出資金等については次のとおりであり、資産(2)「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	1,110
その他有価証券	
非上場株式 ※1	2,985
組合出資金等 ※2	1,336

※1 非上場株式については、市場価格がないことから「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日)第5項に基づき、時価開示の対象とはしていません。

※2 組合出資金等については、時価算定適用指針第27項に基づき、時価開示の対象とはしていません。

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6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677,458百万円であります。

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6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748,788百万円であります。

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)	194,082	短期借入金	305,730
				利息の支払(注)	9,281	長期借入金	336,037
						未払費用	2,111

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1)	203,816	短期借入金	147,677
				利息の支払(注1)	6,020	長期借入金 未払費用	376,543 1,918
				賃料等の受入(注2)	1,501	前受金 受入保証金	184 4,377

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1)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。
(注2)賃料は当社所定の算定式に基づき決定しており、市場賃料等を勘案のうえ適宜見直しています。また、解約違約金等その他の条件は交渉のうえ決定しております。

2020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 ケッツ ヨーロッ 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	3,200
				有価証券貸 借取引収益 (注2)	42	有価証券 担保借入 金	368,045
				有価証券貸 借取引費用 (注2)	470		
				資金の貸付 (注2,3)	176,270	短期貸付 金	179,650
				利息の受取 (注2)	4,810	未収収益	765
				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)	48,457 48,623
親会社の子会社	大和証券 キャピタル・マー ケッツア 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	37,067
				有価証券貸 借取引収益 (注2)	460	有価証券 担保借入 金	197,845
				有価証券貸 借取引費用 (注2)	7,730		
				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)	16,953	未収収益	2,989

2021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 ケッツ ヨーロッ 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	1,100
				有価証券貸 借取引収益 (注2)	41	有価証券 担保借入 金	163,587
				有価証券貸 借取引費用 (注2)	△386		
				資金の貸付 (注2,3)	132,735	短期貸付 金	114,363
				利息の受取 (注2)	1,368	未収収益	179
				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)	41,658 48,768
親会社の子会社	大和証券 キャピタル・マー ケッツア 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	85,597
				有価証券貸 借取引収益 (注2)	△85	有価証券 担保借入 金	367,696
				有価証券貸 借取引費用 (注2)	973		
				有価証券の 購入、売却 (注1,2)	-	-	-

2020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	29,969
				有価証券貸 借取引収益 (注2)	349		
				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)	1,915 5

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、市場実勢等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	919,436円73銭
2. 1株当たり当期純利益	14,374円46銭

その他の注記

該当事項はありません。

重要な後発事象に関する注記

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	641,768
日本銀行	278,357

2021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	大和アセットマネジメント株式会社	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)	14,917	未収収益	3,324
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	-
				有価証券貸 借取引収益 (注2)	4		
				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)	47 175

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、市場実勢等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. 1株当たり純資産額	980,517円50銭
2. 1株当たり当期純利益	51,091円03銭

(減損損失に関する注記)

以下の資産グループについて減損損失を計上しております。

	用途	地域	減損損失(百万円)
処分予定資産	低稼働資産	東北、関東、中部、近畿、中国、四国	2,231
合計			2,231

資産のグルーピングは、管理会計上の区分に従い行っております。また、処分予定資産については、個別物件単位で行っております。

処分の意思決定を行ったことに伴い、帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失に含めて特別損失に計上しております。

金額の内訳は、建物895百万円、土地983百万円、電話加入権349百万円、その他3百万円であります。

なお、処分予定資産の回収可能価額は正味売却価額により測定しており、鑑定評価額等により評価しております。

2020年3月期

2021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	1,019	2,880	1,860
(1) 株券	1,019	2,880	1,860
(2) 債券	—	—	—
(3) その他	—	—	—
合 計	1,019	2,880	1,860

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	6,173
(1) 株券	4,116
(2) 債券	—
(3) その他	2,056
合 計	6,173

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	1,019	3,315	2,295
(1) 株券	1,019	3,315	2,295
(2) 債券	—	—	—
(3) その他	—	—	—
合 計	1,019	3,315	2,295

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	5,432
(1) 株券	4,095
(2) 債券	—
(3) その他	1,336
合 計	5,432

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	2020年3月31日 現在	2021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	318,064	355,456
顧客分別金信託額	350,005	391,009
期末日現在の顧客分別金必要額	279,214	336,299

(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	2020年3月31日現在		2021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	52,239,859 千株	1,775,689 千株	52,276,128 千株	1,802,559 千株
債券	10,355,057 百万円	4,223,893 百万円	10,994,046 百万円	4,227,158 百万円
受益証券	8,384,314 百万口	129,619 百万口	8,196,817 百万口	62,368 百万口
その他 (新株予約権証券)	68個	5,782個	68個	33,324個
その他 (受益証券発行信託の 受益証券)	8,578 百万円	—	15,560 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	2020年3月31日現在	2021年3月31日現在
	数 量	数 量
株券	240,787千株	209,550千株
債券	30,735百万円	26,107百万円
受益証券	71,731百万口	69,504百万口
その他 (受益証券発行信託の 受益証券)	511百万円	638百万円

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 (2021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 (2021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	2020年3月31日 現在	2021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	10,993百万円	10,993百万円	三井住友信託銀行
有価証券等	第三者による管理	20,646千株	18,632千株	証券保管振替機構
有価証券等	第三者による管理	73百万円	73百万円	日本銀行
有価証券等	第三者による管理	10,160百万円	14,065百万円	証券保管振替機構
有価証券等	第三者による管理	21,130百万口	20,348百万口	証券保管振替機構
有価証券等	第三者による管理	36千株	132千株	CitibankNY (米国)
有価証券等	第三者による管理	0百万口	0百万口	CitibankNY (米国)
有価証券等	第三者による管理	50,656百万円	50,098百万円	Euroclear Bank (ベルギー)
有価証券等	第三者による管理	250百万円	254百万円	Daiwa Capital Markets America (米国)
有価証券等	第三者による管理	13千株	164千株	Daiwa Capital Markets (中国(香港))
有価証券等	第三者による管理	326百万口	145百万口	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 (2021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 (2021年7月1日現在)

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
北海道・東北地区		
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
釧路支店	北海道釧路市北大通1丁目1番地2	(0154) 23-0161
青森支店	青森県青森市新町2丁目5番13号	(017) 777-2111
盛岡支店	岩手県盛岡市菜園1丁目12番10号	(019) 652-1171
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
秋田支店	秋田県秋田市中通4丁目5番2号	(018) 831-2811
山形支店	山形県山形市本町2丁目4番9号	(023) 622-8151
福島支店	福島県福島市栄町11番25号	(024) 522-3111
郡山支店	福島県郡山市中央町10番10号	(024) 932-3111
いわき支店	福島県いわき市平字田町1番地の7	(0246) 23-0111
関東地区		
水戸支店	茨城県水戸市泉町2丁目2番2-27 (ニッセイ水戸ビル5階)	(029) 226-9111
宇都宮支店	栃木県宇都宮市本町13番18号	(028) 621-3531
高崎支店	群馬県高崎市八島町58番1号	(027) 327-7111
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
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
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
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
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
熊谷営業所	埼玉県熊谷市筑波3丁目195番地 (熊谷駅前ビル7F)	(048) 637-3488
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
川口支店	埼玉県川口市本町4丁目2番1号	(048) 225-3611
所沢支店	埼玉県所沢市東町12番10号 (ブランドタワー所沢2F)	(04) 2922-8111
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
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
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
船橋支店	千葉県船橋市本町4丁目40番22号	(047) 424-2111
八千代緑が丘 営業所	千葉県八千代市緑が丘1丁目2番19号 (東洋コーポレーション緑が丘ビル)	(047) 419-6910
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
松戸支店	千葉県松戸市本町19番地15	(047) 366-5111
うすい支店	千葉県佐倉市王子台1丁目28番地8	(043) 462-1009
柏支店	千葉県柏市中央町1番1号 (柏セントラルプラザ4F)	(04) 7166-2701
浦安営業所	千葉県浦安市当代島1丁目3番27号 (イワビル2F)	(03) 4531-2120
銀座支店	東京都中央区銀座6-10-1 (GINZA SIX7F)	(03) 3572-2801
新宿支店	東京都新宿区新宿3丁目30番11号	(03) 3352-5141
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
阿佐ヶ谷営業所	東京都杉並区阿佐谷南3丁目31番13号 (稲葉ビル2F)	(03) 4316-7520
上野支店	東京都台東区上野2丁目13番10号	(03) 3832-0191
亀有営業所	東京都葛飾区亀有3丁目26番1号 (リリオ館6F)	(03) 4213-7788
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
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
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
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

店舗名	住 所	電話番号
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
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
蒲田支店	東京都大田区西蒲田7丁目45番6号	(03) 3732-9171
大森支店	東京都大田区大森北1丁目5番1号	(03) 5471-3311
成城支店	東京都世田谷区成城2丁目34番12号	(03) 3415-5211
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
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
渋谷支店	東京都渋谷区道玄坂1丁目12番1号	(03) 3463-9211
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
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
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
中野支店	東京都中野区中野2丁目30番5号	(03) 5385-1311
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
成増営業所	東京都板橋区成増1丁目30番13号 (トーセイ大樹生命ビル2F)	(03) 4354-0280
ひばりヶ丘営業所	東京都西東京市ひばりヶ丘北3丁目5番19号 (カマタビル3F)	(03) 4354-2800
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
ふじみ野営業所	埼玉県富士見市ふじみ野東1丁目1番1号 (ふじみ野ナーレ4F)	(03) 4218-3580
赤羽支店	東京都北区赤羽1丁目9番5号	(03) 3903-0311
練馬支店	東京都練馬区豊玉北5丁目17番13号	(03) 3992-0131
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
千住支店	東京都足立区千住2丁目26番	(03) 3879-6111
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
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
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
武蔵小金井営業所	東京都小金井市本町6丁目2番30号 (SOCOLA武蔵小金井クロス1F)	(0422) 57-3670
国立支店	東京都国立市東1丁目4番地11	(042) 571-0211
立川支店	東京都立川市曙町2丁目7番16号	(042) 526-1711
八王子支店	東京都八王子市旭町8番10号	(042) 644-2211
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
府中営業所	東京都府中市宮町1番40号 (KDX府中ビル9F)	(042) 307-0230
町田支店	東京都町田市原町田6丁目12番20号	(042) 722-2131
相模原営業所	神奈川県相模原市中央区 相模原1丁目2番17号	(042) 719-3590
横浜支店	神奈川県横浜西区高島2丁目19番12号	(045) 452-7001
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 (竜山ビル1F)	(045) 614-6150
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
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
金沢文庫営業所	神奈川県横浜市金沢区谷津町340番地 (金沢文庫シンコービル2F)	(045) 567-0080
戸塚支店	神奈川県横浜市戸塚区戸塚町4100番地	(045) 864-1715
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
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
川崎支店	神奈川県川崎市川崎区駅前本町12番1号 (タワーリパーク9F)	(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
鶴見営業所	神奈川県横浜市鶴見区豊岡町17番2号 (互省ビル5F)	(044) 577-2540
藤沢支店	神奈川県藤沢市藤沢462番地	(0466) 23-8111

店舗名	住 所	電話番号
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3丁目13番4号 (オリオンビル2F)	(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3丁目1番5号 (三谷中央ビル9F)	(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 (ASANOビル3F)	(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
大垣営業所	岐阜県大垣市郭町2丁目25番地 (Kix中央ビル1F)	(058) 257-3510
静岡支店	静岡県静岡市葵区追手町1番1号	(054) 254-3151
藤枝営業所	静岡県藤枝市前島1丁目2番1号 (オーレ藤枝1F)	(054) 663-3322
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3丁目8番23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	愛知県名古屋市中東区明が丘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
豊田営業所	愛知県豊田市喜多町1番140号 (GAZA1F)	(052) 770-0120
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
知立営業所	愛知県知立市栄1番6号 (エキタス知立1F)	(0564) 77-2988
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
四日市営業所	三重県四日市市諏訪栄町1丁目12番地 (朝日生命四日市ビル8F)	(059) 212-0960

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
福知山営業所	京都府福知山市駅前町405 (JTB福知山ビル1F)	(075) 757-6940
草津営業所	滋賀県草津市波川1丁目1番50号 (近鉄百貨店草津店3F)	(075) 757-6950
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
難波支店	大阪府大阪市中央区難波5丁目1番60号	(06) 6632-5151
東大阪営業所	大阪府東大阪足代2丁目1番7号 (ターフーズフラット布施駅前2F)	(06) 4977-6620
堺営業所	大阪府堺市堺区南花田口町2丁目3番1号	(06) 7173-2850
泉ヶ丘営業所	大阪府堺市南区三原台1丁目1番3号 (ジョイパーク泉ヶ丘1F)	(072) 355-1170

店舗名	住 所	電話番号
北野田営業所	大阪府堺市東区北野田1番1号 (ヴェリテ北野田プラチナム1F)	(06) 7176-7600
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
千里中央営業所	大阪府豊中市新千里東町1丁目4番1号 (D44阪急千里中央ビル5F)	(06) 7176-1510
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
神戸支店	兵庫県神戸市中央区加納町4丁目2番1号 (神戸三宮阪急ビル2F)	(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	兵庫県尼崎市昭和通3丁目95番地	(06) 6411-1481
塚口営業所	兵庫県尼崎市塚口町1丁目12番8号 (青山ビル3F)	(06) 7178-3111
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
宝塚営業所	兵庫県宝塚市栄町2丁目1番2号 (ソリオ2 8F)	(0798) 55-7330
奈良支店	奈良県奈良市高天町48番地1	(0742) 23-1271
学園前営業所	奈良県奈良市学園北1丁目10番1号 (パラディ学園前1 2F)	(0742) 55-0550
大和八木営業所	奈良県橿原市内膳町1丁目1番11号 (U・遊上田ビル3F)	(0742) 55-0555
和歌山支店	和歌山県和歌山市東蔵前丁3 9	(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 (日生岡山第二ビル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
春日原営業所	福岡県春日市春日原北町4丁目7番地 (アドバンストラスト18 1F)	(092) 515-1690
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3番5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	宮崎県宮崎市橋通東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	https://www.daiwa.jp/	

開示項目一覧【大和証券グループ本社】 (2021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	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 48
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	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。)
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	17-18
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	4. 金融商品取引業等に関する内閣府令第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 48
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	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。)
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		49-101
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	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 102-103
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	6-12	
②本店又は主たる事務所の所在地	6-12	
③資本金の額、基金の総額又は出資の総額	6-12	
④事業の内容	6-12	
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	6-12	
⑥最終指定親会社及びそ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	6-12	
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	13-20	
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。)	21	
②経常利益又は経常損失	21	
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	21	
④包括利益	21	
⑤純資産額	21	
⑥総資産額	21	
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。)	21	
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	22-46	
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	46	
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	47	

開示項目一覧【大和証券】(2021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	105	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。))	111
2. 沿革及び経営の組織	105～106	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	111
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	108	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。))	111
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		⑩各事業年度終了の日における自己資本規制比率	111
①役員の氏名又は名称	107	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	108
②政令で定める使用人の氏名		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	
・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	107	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。))及び株主資本等変動計算書(関連する注記を含む。))	112～127
・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	107	2. 各事業年度終了の日における次に掲げる事項	
・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	107	①借入金の主要な借入先及び借入金額	126
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。))	108	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	127
④本店その他の営業所又は事務所の名称及び所在地	129～130	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	127
⑤他に事業を行っているときは、その事業の種類	108	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	127
⑥その他内閣府令で定める事項		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	
・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	108	1. 内部管理の状況の概要	110
・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	108	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	128
・加入する投資者保護基金の名称	108	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	
・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	108	1. 金融商品取引業者及びその子会社等の集団の構成	128
5. 法第37条の7第1項第1号口、第2号口、第3号口又は第4号口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	108	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	128
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	109		
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	110		
②経常利益又は経常損失	110		
③当期純利益又は当期純損失	110		
④資本金の額及び発行済株式の総数	110		
⑤受入手数料の内訳	110		
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	110		