

2025年4月28日

各 位

会社名 株式会社大和証券グループ本社

代表者名 代表執行役社長 荻野 明彦

(コード番号 8601 東証プライム・名証プレミア)

連結自己資本規制比率及び連結レバレッジ比率に関するお知らせ

－ 経営の健全性の状況（2024年12月末） －

金融商品取引法第57条の17の規定に基づく大和証券グループ本社の経営の健全性の状況
(2024年12月末) について下記のとおりお知らせいたします。

記

目次

■	主要な指標.....	3
■	自己資本の構成に関する開示事項.....	4
■	自己資本調達手段に関する契約内容の概要.....	7
■	定量的な開示事項.....	22
1.	その他定量的な開示事項.....	22
■	連結レバレッジ比率に関する開示事項.....	24
1.	連結レバレッジ比率の構成に関する開示.....	24
2.	前四半期の連結レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた原因.....	24

■ 主要な指標

【KM1】 主要な指標

(単位: 百万円、%)

国際様式の 該当番号		2024年 12月末	2024年 9月末	2024年 6月末	2024年 3月末	2023年 12月末
資本						
1	普通株式等Tier1 資本の額	1,413,899	1,274,461	1,367,678	1,331,138	1,299,914
2	Tier1資本の額	1,605,012	1,462,684	1,554,875	1,520,820	1,489,647
3	総自己資本の額	1,615,274	1,470,667	1,557,238	1,529,866	1,498,996
リスク・アセット						
4	リスク・アセットの額	7,509,731	7,189,880	7,426,777	7,087,470	6,691,815
自己資本比率						
5	連結普通株式等 Tier1比率	18.82%	17.72%	18.41%	18.78%	19.42%
6	連結Tier1比率	21.37%	20.34%	20.93%	21.45%	22.26%
7	連結総自己資本 比率	21.50%	20.45%	20.96%	21.58%	22.40%
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	0.12%	0.11%	0.10%	0.08%	0.08%
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	3.12%	3.11%	3.10%	3.08%	3.08%
12	連結資本バッファ比率	13.50%	12.45%	12.96%	13.58%	14.40%
連結レバレッジ比率						
13	総エクスポージャーの 額	29,240,454	26,665,976	28,623,154	24,461,756	24,439,442
14	連結レバレッジ比率	5.48%	5.48%	5.43%	6.21%	6.09%

■ 自己資本の構成に関する開示事項

【CC1】 自己資本の構成

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目	当最終指定親会社 四半期末	別紙様式第八号 (CC2)の参照項目
普通株式等Tier1資本に係る基礎項目 (1)			
1a+2-1c-26	普通株式に係る株主資本の額	1,409,505	
1a	うち、資本金及び資本剰余金の額	513,782	(i), (j)
2	うち、利益剰余金の額	1,011,407	(k)
1c	うち、自己株式の額 (△)	115,684	(l), (m)
26	うち、社外流出予定額 (△)	-	
	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	6,448	(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	222,595	(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)	1,638,550	
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	164,061	
8	うち、のれんに係るもの(のれん相当差額を含む。)の額	46,740	(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	117,321	(f)
10	繰延税金資産(一時差異に係るものを除く。)の額	252	(d), (h)
11	繰延ヘッジ損益の額	▲ 131	(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	807	
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	97	(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	-	(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	59,563	
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	59,563	
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)	224,651	
普通株式等Tier1資本			
29	普通株式等Tier1資本の額 ((イ) - (ロ)) (ハ)	1,413,899	

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目	当最終指定親会社 四半期末	別紙様式第八号 (CC2)の参照項目
その他Tier1資本に係る基礎項目 (3)			
30	31a	その他Tier1資本調達手段に係る株主資本の額及びその内訳	-
	31b	その他Tier1資本調達手段に係る新株予約権の額	-
	32	その他Tier1資本調達手段に係る負債の額	147,500
		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	43,613	(q)
33+35	適格旧Tier1資本調達手段の額のうちその他Tier1資本に係る基礎項目の額に含まれる額	-	
33	うち、最終指定親会社及び最終指定親会社の特別目的会社等の発行する資本調達手段の額	-	
35	うち、最終指定親会社の連結子法人等(最終指定親会社の特別目的会社等を除く。)の発行する資本調達手段の額	-	
36	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 (二)	191,113	
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	-	(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	-	
43	その他Tier1資本に係る調整項目の額 (ホ)	-	
その他Tier1資本			
44	その他Tier1資本の額 ((二) - (ホ)) (ヘ)	191,113	
Tier1資本			
45	Tier1資本の額 ((ハ) + (ヘ)) (ト)	1,605,012	
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	10,262	(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)	10,262	

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号	項目	当最終指定親会社 四半期末	別紙様式第八号 (CC2)の参照項目
Tier2資本に係る調整項目			
52	自己保有Tier2資本調達手段の額	-	
53	意図的に保有している他の金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額	-	
54	少数出資金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC関連調達手段の額	-	(a), (b), (c), (g)
54a	少数出資金融機関等のその他外部TLAC 関連調達手段のうち、マーケット・メイク目的保有TLACに該当しなくなったものの額	-	
55	その他金融機関等のTier2資本調達手段及びその他外部TLAC 関連調達手段の額	-	
57	Tier2資本に係る調整項目の額 (リ)	-	
Tier2資本			
58	Tier2資本の額 ((チ) - (リ)) (ヌ)	10,262	
総自己資本			
59	総自己資本の額 ((ト) + (ヌ)) (ル)	1,615,274	
リスク・アセット (5)			
60	リスク・アセットの額の合計額 (ヲ)	7,509,731	
連結自己資本規制比率			
61	連結普通株式等Tier1比率 ((ハ) / (ヲ))	18.82%	
62	連結Tier1比率 ((ト) / (ヲ))	21.37%	
63	連結総自己資本規制比率 ((ル) / (ヲ))	21.50%	
64	最低連結資本バッファ比率	3.12%	
65	うち、資本保全バッファ比率	2.50%	
66	うち、カウンター・シクリカル・バッファ比率	0.12%	
67	うち、G-SIB/D-SIB バッファ比率	0.50%	
68	連結資本バッファ比率	13.50%	
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	147,212	(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	147,346	(a), (b), (c), (g)
74	無形固定資産(モーゲージ・サービシング・ライツに係るものに限る。)に係る調整項目不算入額	-	
75	繰延税金資産(一時差異に係るものに限る。)に係る調整項目不算入額	7,215	(d), (h)
Tier2資本に係る基礎項目の額に算入される引当金に関する事項 (7)			
76	一般貸倒引当金の額	-	
77	一般貸倒引当金に係るTier2資本算入上限額	-	
78	内部格付手法採用最終指定親会社において、適格引当金の合計額から事業法人等向けエクスポージャー及びリテール向けエクスポージャーの期待損失額の合計額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-	
79	適格引当金に係るTier2資本算入上限額	-	
資本調達手段に係る経過措置に関する事項 (8)			
82	適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額	-	
83	適格旧Tier1資本調達手段の額から適格旧Tier1資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-	
84	適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額	-	
85	適格旧Tier2資本調達手段の額から適格旧Tier2資本調達手段に係る算入上限額を控除した額(当該額が零を下回る場合にあっては、零とする。)	-	

■ 自己資本調達手段に関する契約内容の概要

【CCA】 自己資本等の調達手段に関する契約内容の概要

1	発行者	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無
3	準拠法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—
	規制上の取り扱い (2)	
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	普通株式
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)	
	連結自己資本規制比率	1,409,505 百万円
9	額面総額 (5)	—
10	表示される科目の区分 (6)	
	連結貸借対照表	株主資本
11	発行日 (7)	—
12	償還期限の有無	無
13	その日付	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—
	剰余金の配当又は利息の支払	
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動
18	配当率又は利率 (12)	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—
25	転換の範囲 (16)	—
26	転換の比率 (17)	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—
34	その概要	—
34a	劣後性の手段(23)	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2006年7月発行新株予約権	2007年7月発行新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	29 百万円	39 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類 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段 (23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	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	52 百万円	108 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2008年7月1日	2009年7月1日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種類 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段 (23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	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	160 百万円	257 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類 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段 (23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2013年2月発行新株予約権	2014年2月発行新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	336 百万円	293 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類 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段 (23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	2015年2月発行新株予約権	2016年2月発行新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	329 百万円	345 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2015年2月9日	2016年2月16日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種類 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段 (23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	第12回新株予約権	2017年2月発行新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	158 百万円	373 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類 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段 (23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	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	377 百万円	407 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2017年2月8日	2018年2月8日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種類 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段 (23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	第14回新株予約権	第15回新株予約権
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	485 百万円	332 百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	新株予約権	新株予約権
11	発行日 (7)	2018年2月8日	2018年8月10日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種類 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段 (23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	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	264 百万円	535 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類 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段 (23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	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18回新株予約権	第19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	336 百万円	390 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)	2021年8月13日	2022年8月15日
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	無	無
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段 (23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	無	無
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額	普通株式等Tier1資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	第20回新株予約権	第21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	622 百万円	212 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)	2023年8月15日	2024年8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類 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段 (23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	大和アセットマネジメント	大和証券オフィス投資法人
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	—	—
3	準拠法	国内法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—	—
	規制上の取り扱い (2)		
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 Tier2資本に係る基礎項目の額	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 Tier2資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 Tier2資本に係る基礎項目の額	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 Tier2資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	普通株式	普通株式
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)		
	連結自己資本規制比率	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 3,425百万円 Tier2資本に係る基礎項目の額 806百万円	その他Tier1資本に係る基礎項目の額 30,460百万円 Tier2資本に係る基礎項目の額 7,167百万円
9	額面総額 (5)	—	—
10	表示される科目の区分 (6)		
	連結貸借対照表	非支配株主持分	非支配株主持分
11	発行日 (7)	—	—
12	償還期限の有無	無	無
13	その日付	—	—
14	償還等を可能とする特約の有無	—	—
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—	—
	剰余金の配当又は利息の支払		
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動	変動
18	配当率又は利率 (12)	—	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—	—
25	転換の範囲 (16)	—	—
26	転換の比率 (17)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—	—
34	その概要	—	—
34a	劣後性の手段(23)	—	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類(24)	永久劣後債務	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

1	発行者	サムティ・レジデンシャル投資法人
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	—
3	準拠法	国内法
3a	外国法令に準拠する手段(その他外部TLAC 調達手段に限る。)(1)	—
	規制上の取り扱い (2)	
4	2022年3月30日までの期間における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	その他Tier1 資本に係る基礎項目の額 Tier2資本に係る基礎項目の額
5	2022年3月31日以降における自己資本に係る基礎項目の額への算入に係る取扱い	その他Tier1 資本に係る基礎項目の額 Tier2資本に係る基礎項目の額
6	連結自己資本規制比率の算出において自己資本に算入する者 (3)	大和証券グループ本社
7	銘柄、名称又は種類	普通株式
8	自己資本に係る基礎項目の額に算入された額 (4)	
	連結自己資本規制比率	その他Tier1 資本に係る基礎項目の額 9,727百万円 Tier2資本に係る基礎項目の額 2,288百万円
9	額面総額 (5)	—
10	表示される科目の区分 (6)	
	連結貸借対照表	非支配株主持分
11	発行日 (7)	—
12	償還期限の有無	無
13	その日付	—
14	償還等を可能とする特約の有無	—
15	初回償還可能日及びその償還金額 (8)	—
	特別早期償還特約の対象となる事由及びその償還金額 (9)	—
16	任意償還可能日のうち初回償還可能日以外のものに関する概要 (10)	—
	剰余金の配当又は利息の支払	
17	配当率又は利率の種別 (11)	変動
18	配当率又は利率 (12)	—
19	配当等停止条項の有無 (13)	無
20	剰余金の配当又は利息の支払の停止に係る発行者の裁量の有無 (14)	完全裁量
21	ステップアップ金利等に係る特約その他の償還等を行う蓋然性を高める特約の有無	無
22	未配当の剰余金又は未払の利息に係る累積の有無	無
23	他の種類の資本調達手段への転換に係る特約の有無	無
24	転換が生じる場合 (15)	—
25	転換の範囲 (16)	—
26	転換の比率 (17)	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	無
31	元本の削減が生じる場合 (20)	—
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	—
33	元本回復特約の有無 (22)	—
34	その概要	—
34a	劣後性の手段(23)	—
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	永久劣後債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—

1	発行者	大和証券グループ本社	大和証券グループ本社
2	識別のために付された番号、記号その他の符号	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	122,500 百万円	25,000 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類別 (11)	固定から変動	固定から変動
18	配当率又は利率 (12)	2020年3月16日の翌日から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)	—	—
27	転換に係る発行者の裁量の有無 (18)	—	—
28	転換に際して交付される資本調達手段の種類	—	—
29	転換に際して交付される資本調達手段の発行者	—	—
30	元本の削減に係る特約の有無 (19)	有	有
31	元本の削減が生じる場合 (20)	・当社が報告又は公表する連結普通株式等 Tier1比率が5.125%を下回った場合 ・内閣総理大臣が当社について、預金保険法第 126条の2第1項第2号に定める措置である特定第 二号措置を講ずる必要がある旨の認定を行った 場合 ・当社について倒産手続の開始の決定等がなさ れた場合	・当社が報告又は公表する連結普通株式等 Tier1比率が5.125%を下回った場合 ・内閣総理大臣が当社について、預金保険法第 126条の2第1項第2号に定める措置である特定第 二号措置を講ずる必要がある旨の認定を行った 場合 ・当社について倒産手続の開始の決定等がなさ れた場合
32	元本の削減が生じる範囲 (21)	全部削減又は一部削減	全部削減又は一部削減
33	元本回復特約の有無 (22)	有	有
34	その概要	元金回復がなされた直後においても十分に高い 水準の連結普通株式等Tier1比率が維持される ことについて、あらかじめ金融庁その他の監督当 局の確認を受けたうえで、当社が元金の支払義 務の免除の効力を将来に向かって消滅させること を決定する場合	元金回復がなされた直後においても十分に高い 水準の連結普通株式等Tier1比率が維持される ことについて、あらかじめ金融庁その他の監督当 局の確認を受けたうえで、当社が元金の支払義 務の免除の効力を将来に向かって消滅させること を決定する場合
34a	劣後性の手段(23)	契約上の劣後	契約上の劣後
35	残余財産の分配又は倒産手続における債務の弁済若しくは変更について優先的 内容を有する他の種類の資本調達手段又はその他外部TLAC調達手段のうち、最 も劣後的内容を有するものの名称又は種類 (24)	一般債務	一般債務
36	非充足資本等要件の有無 (25)	無	無
37	非充足資本等要件の内容 (25)	—	—

■ 定量的な開示事項

1. その他定量的な開示事項

【OV1】リスク・アセットの概要

(単位 百万円)

国際様式の 該当番号		リスク・アセット		所要自己資本	
		2024年 12月末	2024年 9月末	2024年 12月末	2024年 9月末
1	信用リスク	2,406,828	2,383,617	192,546	190,689
2	うち、標準的手法適用分	1,227,906	1,237,232	98,232	98,978
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	1,178,921	1,146,384	94,313	91,710
4	カウンターパーティ信用リスク	1,291,518	1,257,861	103,321	100,628
5	うち、SA-CCR適用分	377,086	358,750	30,166	28,700
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	388,866	375,723	31,109	30,057
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	35,648	30,189	2,851	2,415
	その他	489,916	493,198	39,193	39,455
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（レック・スルー方式）	366,413	338,354	29,313	27,068
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（マンドレート方式）	51,064	43,890	4,085	3,511
	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%）	33,006	32,002	2,640	2,560
	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%）	177	160	14	12
11	未決済取引	438	6,030	35	482
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	245,083	226,352	19,606	18,108
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	209,557	191,306	16,764	15,304
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	35,525	35,045	2,842	2,803
16	マーケット・リスク	1,480,079	1,299,267	118,406	103,941
17	うち、標準的方式適用分	911,267	862,069	72,901	68,965
18	うち、内部モデル方式適用分	568,811	437,197	45,504	34,975
19	オペレーショナル・リスク	1,247,549	1,247,549	99,803	99,803
20	うち、基礎的手法適用分	1,247,549	1,247,549	99,803	99,803
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	387,573	354,793	31,005	28,383
	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	7,509,731	7,189,880	600,778	575,190

【MR2】 内部モデル方式を適用して算出されたリスク・アセットの額の変動要因

(単位 百万円)

	前四半期末:2024年9月末 当四半期末:2024年12月末	バリュエーション・ アット・リスク	ストレス・ バリュエーション・ 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	153,221	283,976	-	-		437,197
1b	前四半期末における連結自己資本規制上のリスク・アセット額への調整	3.09	2.15	-	-		2.41
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	49,429	131,562	-	-		180,991
2	当四半期の 要因別の 変動額	リスク量の変動	▲ 13,755	▲ 25,362	-	-	▲ 39,118
3		モデルの更新又は変更	-	-	-	-	-
4		手法及び方針	-	-	-	-	-
5		買収及び売却	-	-	-	-	-
6		為替の変動	-	-	-	-	-
7		その他	-	-	-	-	-
8a	当四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	35,673	106,200	-	-		141,873
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	5.48	3.51	-	-		4.00
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	195,492	373,319	-	-		568,811

■ 連結レバレッジ比率に関する開示事項

1. 連結レバレッジ比率の構成に関する開示

(単位 百万円 %)

国際様式 (表2)の 該当番号	国際様式 (表1)の 該当番号	項目	2024年12月末	2024年9月末
オン・バランス資産の額 (1)				
1		調整項目控除前のオン・バランス資産の額	14,963,804	14,494,641
1a	1	連結貸借対照表における総資産の額	33,146,479	30,614,256
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。)	1,349	1,470
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(△)	18,184,024	16,121,085
2	7	Tier1 資本に係る調整項目の額(△)	223,974	247,870
3		オン・バランス資産の額 (イ)	14,739,830	14,246,771
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	909,422	615,788
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	540,235	529,214
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(△)	27,992	71,050
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	3,753,196	3,570,030
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(△)	3,383,404	3,175,731
11	4	デリバティブ取引等に関する額 (ロ)	1,791,457	1,468,251
レポ取引等に関する額 (3)				
12		レポ取引等に関する資産の額	16,658,219	14,638,853
13		レポ取引等に関する資産の額から控除した額(△)	4,332,867	4,042,065
14		レポ取引等に関するカウンターパーティ・リスクのエクスポージャーの額	265,874	228,014
15		代理取引のエクスポージャーの額		
16	5	レポ取引等に関する額 (ハ)	12,591,226	10,824,802
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	168,683	180,011
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(△)	50,742	53,859
19	6	オフ・バランス取引に関する額 (ニ)	117,941	126,152
連結レバレッジ比率 (5)				
20		資本の額 (ホ)	1,605,012	1,462,684
21	8	総エクスポージャーの額((イ)+(ロ)+(ハ)+(ニ)) (ヘ)	29,240,454	26,665,976
22		連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ))	5.48%	5.48%
		適用する所要連結レバレッジ比率	3.15%	3.15%
		適用する所要連結レバレッジ・バッファ率	-	-
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)	29,240,454	26,665,976
		日本銀行に対する預け金の額	3,561,893	3,080,619
		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')	32,802,347	29,746,595
		日本銀行に対する預け金を算入する場合の連結レバレッジ比率((ホ)/(ヘ'))	4.89%	4.91%

2. 前四半期の連結レバレッジ比率との間に著しい差異を生じた原因

当四半期と前四半期の連結レバレッジ比率の差異はありません。

以 上