

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成28年2月5日

【会社名】 株式会社大和証券グループ本社

【英訳名】 Daiwa Securities Group Inc.

【代表者の役職氏名】 執行役社長 日比野 隆司

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【電話番号】 03(5555)1111

【事務連絡者氏名】 財務部長 太田 一成

【最寄りの連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【電話番号】 03(5555)1111

【事務連絡者氏名】 財務部長 太田 一成

【届出の対象とした募集有価証券の種類】 新株予約権証券

【届出の対象とした募集金額】 その他の者に対する割当 0円
発行価額の総額に新株予約権の行使に際して払い込むべき金額の
合計額を合算した金額 3,263,455,200円
(注) 1. 本募集は、平成27年6月25日開催の当社第78回定時株主
総会の特別決議及び平成28年2月5日開催の当社執行役
会決議に基づき、ストック・オプションを目的として新
株予約権を発行するものであります。
2. 募集金額は、ストック・オプションとしての目的で発行
することから無償で発行するものといたします。また、
発行価額の総額に新株予約権の行使に際して払い込むべ
き金額の合計額を合算した金額は、平成28年2月4日に
おける東京証券取引所の当社普通株式の普通取引の終値
により算出した見込額であります。

【安定操作に関する事項】 該当事項はありません。

【縦覧に供する場所】 株式会社東京証券取引所
(東京都中央区日本橋兜町2番1号)
株式会社名古屋証券取引所
(名古屋市中区栄三丁目8番20号)

第一部 【証券情報】

第1 【募集要項】

1 【新規発行新株予約権証券(第12回新株予約権)】

(1) 【募集の条件】

発行数	4,484個
発行価額の総額	0円
発行価格	0円
申込手数料	該当事項はありません。
申込単位	1個
申込期間	平成28年2月15日
申込証拠金	0円
申込取扱場所	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号 株式会社大和証券グループ本社 人事部
払込期日	該当事項はありません。
割当日	平成28年2月16日
払込取扱場所	該当事項はありません。

- (注) 1. 本新株予約権証券は、平成27年6月25日開催の当社第78回定時株主総会及び平成28年2月5日開催の当社執行役会の決議に基づき発行されるものであります。
2. 申込みの方法は、平成28年2月15日に「新株予約権申込証」を提出して、当社との間で「新株予約権割当契約書」を締結するものであります。
3. 本新株予約権の募集は、ストック・オプションの目的をもって行うものであり、当社、当社子会社及び当社関連会社の使用人、並びに当社子会社及び当社関連会社の取締役及び執行役員に対して新株予約権を割り当てるものであります。
4. 本募集の対象となる者の人数及び発行数は以下のとおりであります。

割当対象者	人数	新株予約権の発行数
当社使用人	1名	7個
完全子会社取締役	5名	19個
完全子会社使用人	3,158名	4,334個
子会社取締役	0名	0個
子会社使用人	10名	10個
関連会社役職員	64名	114個
合計	3,238名	4,484個

(2) 【新株予約権の内容等】

新株予約権の目的となる株式の種類	当社普通株式 普通株式とは、完全議決権株式であり、権利内容に何ら限定のない当社における標準となる株式です。また、単元株式数は1,000株です。
新株予約権の目的となる株式の数	1 4,484,000株 2 新株予約権の目的である株式の種類は普通株式とし、新株予約権1個当たりの目的である株式の数(以下「付与株式数」という。)は1,000株とします。 ただし、欄外(注)1の定めにより株式数の調整を受けることがあります。
新株予約権の行使時の払込金額	新株予約権1個当たりの行使時の払込金額は、新株予約権の行使により発行又は移転する株式1株当たりの払込金額(以下「行使価額」という。)に付与株式数を乗じた金額とします。 行使価額は、新株予約権を割り当てる日(以下「割当日」という。)の属する月の前月の各日である、平成28年1月の各日(取引が成立しない日を除く。)における東京証券取引所の当社普通株式の普通取引の終値の平均値、又は割当日である平成28年2月16日の終値(終値がない場合は、それに先立つ直近日の終値とする。)のいずれか高い額に1.05を乗じた金額とし、1円未満の端数は切り上げるものとします。 ただし、欄外(注)2の定めにより行使価額の調整を受けることがあります。
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価額の総額	3,263,455,200円 新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価額の総額は、平成28年2月4日における東京証券取引所の当社普通株式の普通取引の終値により算出した見込額であります。
新株予約権の行使により株式を発行する場合の株式の発行価格及び資本組入額	1 新株予約権の行使により株式を発行する場合の1株当たりの発行価格は、行使価額とします。 2 新株予約権の行使により株式を発行する場合における増加する資本金及び資本準備金 新株予約権の行使により株式を発行する場合において増加する資本金の額は、会社計算規則第17条第1項の規定に従い算出される資本金等増加限度額の2分の1の金額とし、計算の結果1円未満の端数が生じたときは、その端数を切り上げるものとします。 新株予約権の行使により株式を発行する場合において増加する資本準備金の額は、上記記載の資本金等増加限度額から上記に定める増加する資本金の額を減じた額とします。
新株予約権の行使期間	平成32年7月1日から平成37年6月24日までとします。
新株予約権の行使請求の受付場所、取次場所及び払込取扱場所	1 新株予約権の行使請求の受付場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号 株式会社大和証券グループ本社 人事部 2 新株予約権の行使請求の払込取扱場所 東京都千代田区丸の内一丁目1番2号 株式会社三井住友銀行 東京営業部
新株予約権の行使の条件	1 各新株予約権の一部行使はできないものとします。 2 その他の権利行使の条件は、当社と新株予約権の権利者との間で締結する新株予約権割当契約において定めるところによるものとします。
自己新株予約権の取得の事由及び取得の条件	新株予約権の権利者が新株予約権を行使しうる条件に該当しなくなった場合、又は新株予約権の権利者が新株予約権の全部又は一部を放棄した場合には、当社は当該新株予約権を無償で取得するものとします。
新株予約権の譲渡に関する事項	譲渡による新株予約権の取得については、当社の取締役会の承認を要するものとします。
代用払込みに関する事項	該当事項はありません。
組織再編成行為に伴う新株予約権の交付に関する事項	該当事項はありません。

(注) 1. 株主総会における決議の日(以下「決議日」という。)後に、当社が当社普通株式の株式分割(株式無償割当てを含む。以下同じ。)又は株式併合を行う場合は、新株予約権のうち、当該株式分割又は株式併合の時点で行使されていない新株予約権について、次の算式により付与株式数の調整を行い、調整の結果生じる1円未満の端数は、これを切り捨てます。

調整後付与株式数 = 調整前付与株式数 × 分割又は併合の比率

また、決議日後に当社が合併、会社分割又は資本金の額の減少を行う場合その他これらの場合に準じ付与株式数の調整を必要とする場合には、合理的な範囲で、付与株式数は適切に調整されるものとします。

2. 割当日後、当社が当社普通株式につき株式分割又は株式併合を行う場合は、行使価額は、次の算式により調整されるものとし、調整により生じる1円未満の端数は切り上げます。

$$\text{調整後行使価額} = \text{調整前行使価額} \times \frac{1}{\text{分割又は併合の比率}}$$

また、割当日後、当社が時価を下回る価額で当社普通株式につき、新株の発行を行う場合(当社普通株式に転換される証券もしくは転換できる証券又は当社普通株式の交付を請求できる新株予約権(新株予約権付社債に付されたものを含む。))の転換又は行使の場合を除く。)には、次の算式により行使価額の調整を行い、調整により生じる1円未満の端数は切り上げます。

$$\text{調整後行使価額} = \text{調整前行使価額} \times \frac{\text{既発行株式数} + \frac{\text{新規発行株式数} \times 1 \text{株当たり払込金額}}{\text{新規発行前の時価}}}{\text{既発行株式数} + \text{新規発行株式数}}$$

上記の算式において、「既発行株式数」とは、当社の発行済普通株式数から当社が保有する普通株式に係る自己株式を控除した数とします。

上記のほか、割当日後に当社が合併、会社分割又は資本金の額の減少を行う場合その他これらの場合に準じ行使価額の調整を必要とする場合には、合理的な範囲で、行使価額は適切に調整されるものとし、

3. 新株予約権の効力発生時期

新株予約権行使の効力は、新株予約権行使請求書及び添付書類が行使請求の受付場所に提出され、かつ、払込金が払込取扱場所の指定口座に払い込まれた時に生ずるものとします。

4. 株式の交付方法

当社は新株予約権の行使の効力発生後速やかに、当該新株予約権を行使した者の本人名義の振替口座簿への記載もしくは記録により、当該新株予約権の目的である株式を発行又は移転するものとします。

(3) 【新株予約権証券の引受け】

該当事項はありません。

2 【新規発行による手取金の使途】

(1) 【新規発行による手取金の額】

払込金額の総額(円)	発行諸費用の概算額(円)	差引手取概算額(円)
3,263,455,200	2,000,000	3,261,455,200

(注) 1. 払込金額の総額は、新株予約権の行使による払込金額の総額であり、平成28年2月4日における東京証券取引所の当社普通株式の普通取引の終値により算出した見込額であります。

2. 「発行諸費用の概算額」には、消費税等は含まれておりません。

(2) 【手取金の使途】

今回の募集は、新株予約権の割当の対象者の連結業績向上へのインセンティブを高めるとともに優秀な人材を確保するため、ストック・オプションの目的で新株予約権を発行するものであり、資金調達を主たる目的としておりません。

また、資金の払込みは、新株予約権を付与された者の判断によるため、現時点でその金額及び時期を資金計画に織り込むことは困難であります。

従って、手取金は、設備資金あるいは運転資金に充当する予定であります。具体的な金額については、払込みのなされた時点の資金繰り状況に応じて決定いたします。

第2 【売出要項】

該当事項はありません。

第3 【第三者割当の場合の特記事項】

該当事項はありません。

第4 【その他の記載事項】

該当事項はありません。

第二部 【公開買付けに関する情報】

第1 【公開買付けの概要】

該当事項はありません。

第2 【統合財務情報】

該当事項はありません。

第3 【発行者（その関連者）と対象者との重要な契約】

該当事項はありません。

第三部 【参照情報】

第1 【参照書類】

会社の概況及び事業の概況等金融商品取引法第5条第1項第2号に掲げる事項については、以下に掲げる書類を参照してください。

1 【有価証券報告書及びその添付書類】

事業年度 第78期(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)

平成27年6月26日関東財務局長に提出

2 【四半期報告書又は半期報告書】

事業年度 第79期第1四半期(自平成27年4月1日 至平成27年6月30日)

平成27年8月14日関東財務局長に提出

事業年度 第79期第2四半期(自平成27年7月1日 至平成27年9月30日)

平成27年11月13日関東財務局長に提出

3 【臨時報告書】

企業内容等の開示に関する内閣府令第19条第2項第9号の2の規定に基づく臨時報告書

平成27年6月29日に関東財務局長に提出

企業内容等の開示に関する内閣府令第19条第2項第6号の2の規定に基づく臨時報告書

平成27年7月27日に関東財務局長に提出

第2 【参照書類の補完情報】

参照書類である有価証券報告書(第78期事業年度)又は四半期報告書(第79期第1四半期及び第79期第2四半期)(以下「有価証券報告書等」という)に記載された「事業等のリスク」について、当該有価証券報告書等の提出日以降、本有価証券届出書提出日までの間において生じた変更は次のとおりであります。変更箇所については下線で示しております。

なお、当該有価証券報告書等には将来に関する事項が記載されておりますが、以下の記載に含まれる事項を除き、本有価証券届出書提出日現在においてもその判断に変更はなく、また新たに記載する将来に関する事項もありません。

(14) 自己資本規制・流動性規制に関するリスク

当社グループは、当社が金融商品取引法上の最終指定親会社に該当するため、「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)の適用を受け、同告示第2条に基づいて連結自己資本規制比率を所定の比率(連結普通株式等Tier1比率4.5%、連結Tier1比率6%、連結総自己資本規制比率8%。以下、「最低所要連結自己資本規制比率」と総称する。)以上に維持する必要があります。

また、連結子会社のなかにも同様に類似の規制を受けている会社があります。大和証券、日の出証券株式会社及びリテラ・クリア証券株式会社は、金融商品取引法に定める自己資本規制比率を同法に基づいて120%以上に維持する必要があります。大和ネクスト銀行は、「銀行法第14条の2の規定に基づき、銀行がその保有する資産等に照らし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18年金融庁告示第19号)に定める自己資本比率(国内基準)を同告示に基づいて4%以上に維持する必要があります。海外の連結子会社についても同様の会社があります。

当社グループは、平成27年3月末より「金融商品取引法第57条の17第1項の規定に基づき、最終指定親会社が当該最終指定親会社及びその子法人等の経営の健全性を判断するための基準として定める最終指定親会社及びその子法人等の経営の健全性のうち流動性に係る健全性の状況を表示する基準」(平成26年金融庁告示第61号)が適用され、同告示に基づいて連結流動性カバレッジ比率を所定の比率(平成27年は60%、以降毎年10%上昇し平成31年以降は100%)以上に維持する必要があります。

また、同時に「金融庁長官が定める場合において、最終指定親会社が経営の健全性の状況を記載した書面に記載すべき事項を定める件第3条第1項の規定に基づき、金融庁長官が別に定める連結レバレッジ比率」(平成27年金融庁告示第11号)が適用され、同告示に基づいて連結レバレッジ比率を算出・開示することが必要になります。

また当社グループは、当社が金融商品取引法上の最終指定親会社に該当するため、上記の最低所要連結自己資本規制比率の充足に加え、平成28年3月末から、一定の最低連結資本バッファ比率を充足することも必要となります。さらに、当社は平成27年12月に、国際間の合意に沿って金融庁より国内のシステム上重要な銀行(D-SIBs: Domestic Systemically Important Banks)の一つに指定されたため、最終指定親会社に関する告示(平成27年金融庁告示第81号)に基づき、追加的に0.5%を上乗せした最低連結資本バッファ比率を維持する必要があります。なお、この基準は平成28年3月末から3年を経過する日までの間は段階的に適用されることになっています。

当社グループの上記比率又は連結子会社の自己資本規制比率が著しく低下した場合には、レピュテーションリスクの波及や信用水準の低下により流動性懸念が生ずる可能性があります。さらに、上記の各規制により要請される最低基準を下回った場合に有効な対策(資本増強策等)を講じられない場合には、内外の監督当局から業務改善命令や業務の全部又は一部の停止等の措置を受ける可能性があります。

第3 【参照書類を縦覧に供している場所】

株式会社大和証券グループ本社 本店
(東京都千代田区丸の内一丁目9番1号)
株式会社東京証券取引所
(東京都中央区日本橋兜町2番1号)
株式会社名古屋証券取引所
(名古屋市中区栄三丁目8番20号)

第四部 【提出会社の保証会社等の情報】

該当事項はありません。

第五部 【特別情報】

第1 【保証会社及び連動子会社の最近の財務諸表又は財務書類】

該当事項はありません。