

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成28年2月15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)

## 1 【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成28年2月5日付で提出した有価証券届出書の記載事項のうち、平成28年2月15日に四半期報告書(事業年度 第79期第3四半期(自平成27年10月1日 至平成27年12月31日))及び自己株券買付状況報告書を関東財務局長に提出したことに伴い、当該四半期報告書を参照書類に追加し、併せてこれに関連する事項を訂正するため、及び当該自己株券買付状況報告書を添付書類に追加するため、有価証券届出書の訂正届出書を提出するものであります。

## 2 【訂正事項】

### 第三部 参照情報

#### 第1 参照書類

(添付書類の削除)

- ・第79期第3四半期(平成27年4月1日から平成27年12月31日まで)の業績の概要

(添付書類の追加)

- ・自己株券買付状況報告書

#### 第2 参照書類の補完情報

## 3 【訂正箇所】

訂正箇所は\_\_\_\_\_線で示しております。

## 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。

(訂正前)

#### 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

(訂正後)

#### 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  
事業年度 第79期第3四半期(自平成27年10月1日 至平成27年12月31日)  
平成28年2月15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】

(訂正前)

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。

(訂正後)

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、第79期第2四半期及び第79期第3四半期)(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その他の事由はありません。

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、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。

(注) 第79期第2四半期報告書の提出日以降、第79期第3四半期報告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。

(1) 日本及び世界の景気、経済情勢、金融市場の変動に関するリスク

米国では、雇用や住宅販売といった主要景気指標に改善の兆しがあるものの、政府による金融量的緩和策の縮小の進行、利上げによる景気の停滞リスクを孕んでいます。また、欧州地域においては、ECBによる支援策等により一時の危機的状況は脱したとみられるものの、その先行きは依然として不透明な状況です。再び、信用不安や財政問題が発生した場合には、世界的な金融危機や経済危機に発展する可能性も否定できません。

一方、日本経済は平成24年11月を底に回復局面に入り、長年の懸念とされてきた社会保障の充実安定化と財政健全化の同時達成による日本経済再生を目指し、平成26年4月に17年ぶりの消費税率の引上げが行われました。しかしながら、今後、消費税増税に伴う経済対策の効果が見られず財政問題が再び深刻化したような場合や、このところ回復基調にある欧米諸国経済の低迷、中国や新興国における経済成長の鈍化が顕在化する場合には、日本経済が再び低迷の危機に陥る可能性も否定できません。

このように、日本を取り巻く経済環境に悪影響を及ぼす事象が発生した場合、又は世界の景気や経済情勢が停滞若しくは悪化した場合には、企業業績の悪化、株価の下落、為替の変動、金利の変動(日本銀行のマイナス金利政策によるものを含む。)等により様々なリスクが顕在化することが想定されます。このような事態は、当社グループの事業、財政状態及び経営成績に重大な悪影響を及ぼす可能性があります。

(10) 銀行業に伴うビジネス・リスク

当社グループでは、連結子会社である株式会社大和ネクスト銀行(以下、「大和ネクスト銀行」という。)が銀行営業免許を取得し、同行を所属銀行とする銀行代理業許可を取得した大和証券株式会社(以下、「大和証券」という。)と共に、平成23年5月よりお客様向けサービスを提供しております。

大和ネクスト銀行においては、銀行代理店である大和証券やインターネット等を通じたお客様からの預金受入れ等により調達した資金を、貸出や債券その他有価証券投資等により運用しておりますが、銀行業は、信用リスク、市場リスク、流動性リスク、システムリスク、コンプライアンスリスク、事務リスク、情報セキュリティリスク、外部委託にかかるリスク、イベントリスク、レピュテーションリスク、自己資本比率低下リスク等、様々なリスクへの対応が必要となります。このような広範に渡るリスクの管理態勢の整備・改善等の対応を進めておりますが、これらの対応が不十分であった場合、マイナス金利政策等による運用資産の利回り低迷や調達金利の上昇等により期待された利鞘が確保できない場合、競合する他の銀行との差別化戦略が期待どおりに進まず競争力が発揮できなかった場合等においては、当社グループの業績に悪影響を及ぼす可能性があります。

## (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。