

平成 24 年 8 月 21 日

各 位

株式会社大和ネクスト銀行

(訂正) 「2011 中間期ディスクロージャー誌」の訂正について

平成 24 年 1 月 26 日に公表しました「2011 中間期ディスクロージャー誌」について、一部に誤りがありましたので、お詫び申し上げますとともに、以下のとおり訂正いたします。(訂正箇所には下線を付して表示しております。)

○30 ページ <主要経営指標等>

【訂正前】 **【訂正後】**

(単位：百万円)

	平成 23 年度中間期	平成 23 年度中間期
経常収益	2,293	2,293
経常損失	1,010	1,010
中間純損失	714	714
資本金	20,000	20,000
発行済株式数 (普通株式)	4,000 株	4,000 株
純資産額	38,410	38,410
総資産額	1,040,724	1,040,724
預金残高	913,014	913,014
貸出金残高	10,812	10,812
有価証券残高	930,425	930,425
単体自己資本比率 (国内基準)	<u>23.05%</u>	<u>28.04%</u>
従業員数	81 人	81 人

○42 ページ 自己資本の構成に関する事項

【訂正前】 **【訂正後】**

(単位：百万円)

項 目	平成 23 年 9 月末	平成 23 年 9 月末
基本的項目 (Tier1)		
資本金	20,000	20,000
うち非累積的永久優先株	—	—
新株式申込証拠金	—	—
資本準備金	20,000	20,000
その他資本剰余金	—	—
利益準備金	—	—
その他利益剰余金	△1,734	△1,734
その他	—	—
自己株式 (△)	—	—
自己株式申込証拠金	—	—
社外流出予定額 (△)	—	—
その他有価証券の評価差損 (△)	—	—
新株予約権	—	—
営業権相当額 (△)	—	—
のれん相当額 (△)	—	—
企業結合により計上される無形固定資産相当額 (△)	—	—
証券化取引により増加した自己資本に相当する額 (△)	—	—
【基本的項目】計 (A)	38,265	38,265

うちステップ・アップ金利条項付の優先出資証券	—	—
うち海外特別目的会社が発行する優先出資証券	—	—
補完的項目 (Tier2)		
土地の再評価額と再評価の直前の帳簿価額の差額の45%相当額	—	—
一般貸倒引当金	0	0
負債性資本調達手段等	—	—
うち永久劣後債務	—	—
うち期限付劣後債務及び期限付優先株	—	—
補完的項目不算入額 (△)	—	—
[補完的項目] 計 (B)	0	0
準補完的項目 (Tier3)		
短期劣後債務	—	—
準補完的項目不算入額 (△)	—	—
[準補完的項目] 計 (C)	—	—
自己資本総額 (A+B+C) (D)	38,265	38,265
控除項目		
他の金融機関の資本調達手段の意図的な保有相当額	—	—
永久劣後債務及びこれに準ずるもの	—	—
期限付劣後債務及び期限付優先株並びにこれらに準ずるもの	—	—
短期劣後債務及びこれに準ずるもの	—	—
非同時決済取引に係る控除額及び信用リスク削減手法として用いる保証又はクレジット・デリバティブの免責額に係る控除額	—	—
基本的項目からの控除分を除く、自己資本控除とされる証券化エクスポージャー及び信用補完機能を持つ I/0 ストリップス (告示第 247 条を準用する場合を含む)	—	—
控除項目不算入額 (△)	—	—
[控除項目] 計 (E)	—	—
自己資本額 (D) - (E) (F)	38,265	38,265
リスク・アセット等		
資産 (オン・バランス) 項目	<u>161,624</u>	<u>132,958</u>
オフ・バランス取引等項目	<u>2,237</u>	<u>1,385</u>
オペレーショナル・リスク相当額を 8% で除して得た額	2,116	2,116
リスク・アセット等合計 (G)	<u>165,978</u>	<u>136,460</u>
自己資本比率 (国内基準) (F) / (G)	<u>23.05%</u>	<u>28.04%</u>
参考: Tier1 比率 (国内基準) (A) / (G)	<u>23.05%</u>	<u>28.04%</u>

※項目名についても訂正しております。なお、訂正後の項目名により記載しております。

○43 ページ 自己資本の充実度に関する事項

信用リスクに対する所要自己資本の額
総所要自己資本額

【訂正前】

(単位: 百万円)

項目	平成 23 年 9 月末	
	リスク・アセットの額	所要自己資本額
資産 (オン・バランス) 項目		
(1) ソブリン向け	<u>29,268</u>	<u>1,170</u>
(2) 金融機関等向け	<u>12,313</u>	<u>492</u>
(3) 法人等向け	<u>106,787</u>	<u>4,271</u>
(4) 中小企業等・個人向け	—	—
(5) 抵当権付住宅ローン向け	—	—
(6) 3ヶ月以上延滞等	—	—
(7) その他	<u>10,428</u>	<u>417</u>
証券化エクスポージャー	2,824	112
資産 (オン・バランス) 計	<u>161,624</u>	<u>6,464</u>

オフ・バランス取引等	2,237	89
合 計	163,861	6,554

(単位：百万円)

	平成 23 年 9 月末	
	所要自己資本	
信用リスク（標準的手法）		6,554
オペレーショナル・リスク（基礎的手法）		84
合 計		6,639

【訂 正 後】

(単位：百万円)

	平成 23 年 9 月末	
	リスク・アセットの額	所要自己資本額
資産（オン・バランス）項目		
(1) ソブリン向け	12,279	491
(2) 金融機関等向け	8,560	342
(3) 法人等向け	99,241	3,969
(4) 不動産取得等事業向け	5,177	207
(5) その他	4,875	195
証券化エクスポージャー	2,824	112
資産（オン・バランス）計	132,958	5,318
オフ・バランス取引等	1,385	55
合 計	134,344	5,373

(単位：百万円)

	平成 23 年 9 月末	
	所要自己資本	
信用リスク（標準的手法）		5,373
オペレーショナル・リスク（基礎的手法）		84
合 計		5,458

○43 ページ 信用リスクに関する事項（証券化エクスポージャーを除く）

信用リスク・エクスポージャー中間期末残高及びエクスポージャーの主な種類別の内訳
信用リスク・エクスポージャー中間期末残高のうち、地域別、取引相手の別、残存期間別の
区分ごとの額及びそれらのエクスポージャーの主な種類別の内訳
3ヶ月以上延滞エクスポージャーの中間期末残高又はデフォルトしたエクスポージャーの中
間期末残高

【訂 正 前】

(単位：百万円)

	平成 23 年 9 月末			
	信用リスク・エクスポージャー中間期末残高		3ヶ月以上延滞 エクスポージャー	
		うち有価証券	うちデリバティブ	
国内	792,374	654,838	2,464	—
国外	277,235	277,080	—	—
地域別合計	1,069,610	931,919	2,464	—
ソブリン向け	771,884	675,024	—	—
金融機関向け	36,656	31,787	2,464	—

法人向け	250,640	219,930	—	—
中小企業等・個人向け	—	—	—	—
抵当権付住宅ローン向け	—	—	—	—
3ヶ月以上延滞等	—	—	—	—
その他	10,428	5,177	—	—
取引相手の別合計	1,069,610	931,919	2,464	—
1年以下	94,077	1,494	—	—
1年超	974,595	930,425	2,464	—
期間の定めのないもの等	938	—	—	—
残存期間別合計	1,069,610	931,919	2,464	—

【訂正後】

(単位：百万円)

	平成23年9月末			
	信用リスク・エクスポージャー	中間期末残高		3ヶ月以上延滞 エクスポージャー
		うち有価証券	うちデリバティブ	
国内	1,291,194	1,111,842	3,372	—
国外	76,318	75,260	1,058	—
地域別合計	1,367,513	1,187,102	4,431	—
ソブリン向け	1,030,465	933,705	—	—
金融機関向け	35,986	28,289	4,431	—
法人向け	260,458	219,930	—	—
不動産取得等事業向け	5,177	5,177	—	—
その他	35,425	—	—	—
取引相手の別合計	1,367,513	1,187,102	4,431	—
1年以下	42,222	1,493	—	—
1年超	1,233,253	1,185,608	4,431	—
期間の定めのないもの等	92,037	—	—	—
残存期間別合計	1,367,513	1,187,102	4,431	—

○44 ページ 信用リスクに関する事項（証券化エクスポージャーを除く）

一般貸倒引当金、個別貸倒引当金及び特定海外債権引当勘定の中間期末残高及び期中の増減額

【訂正前】

(単位：百万円)

		平成23年度中間期			
		期首残高	期中増加額	期中減少額	中間期末残高
一般貸倒引当金	2011年度中間期	—	—	—	0
個別貸倒引当金	2011年度中間期	—	—	—	—
特定海外債権引当金	2011年度中間期	—	—	—	—
合計	2011年度中間期	—	—	—	0

【訂正後】

(単位：百万円)

		平成23年度中間期			
		期首残高	期中増加額	期中減少額	中間期末残高
一般貸倒引当金		—	0	—	0
個別貸倒引当金		—	—	—	—
特定海外債権引当勘定		—	—	—	—
合計		—	0	—	0

○44 ページ 信用リスクに関する事項（証券化エクスポージャーを除く）
 リスク・ウェイトの区分ごとのエクスポージャーの額等

【訂正前】

(単位：百万円)

告示で定めるリスク・ウェイト区分	平成 23 年 9 月末	
	エクスポージャーの額	
	格付あり	格付なし
0%	533,761	127,310
10%	101,015	—
14.5%	2,834	—
20%	39,798	—
40%	—	—
50%	244,651	—
100%	14,943	5,295
350%	—	—
自己資本控除	—	—
合 計	937,004	132,605

【訂正後】

(単位：百万円)

告示で定めるリスク・ウェイト区分	平成 23 年 9 月末	
	エクスポージャーの額	
	格付あり	格付なし
0%	866,725	127,310
10%	103,577	—
20%	84,572	—
50%	162,161	—
100%	15,000	8,166
自己資本控除	—	—
合 計	1,232,036	135,476

○45 ページ 信用リスク削減手法に関する事項
 信用リスク削減手法が適用されたエクスポージャー

【訂正前】

(単位：百万円)

信用リスク削減手法	平成 23 年 9 月末
	信用リスク削減手法が適用されたエクスポージャー
適格金融資産担保合計	—
現金及び自行預金	—
金	—
債権	—
その他	—
適格保証、クレジット・デリバティブ合計	—
保証	—
クレジット・デリバティブ	—
合 計	—

【訂 正 後】

(単位：百万円)

信用リスク削減手法	平成 23 年 9 月末
	信用リスク削減手法が適用されたエクスポージャー
適格金融資産担保合計	40,268
現金及び自行預金	40,268
適格保証、クレジット・デリバティブ合計	2,662
保証	2,662
合 計	42,930

○45 ページ 派生商品取引及び長期決済期間取引の取引相手のリスクに関する事項
与信相当額

【訂 正 前】

(単位：百万円)

	平成 23 年 9 月末
グロス再構築コストの額	417
グロスのアドオンの額	5,163
グロスの与信相当額	5,580
(i) 外国為替関連取引	—
(ii) 金利関連取引	5,580
(iii) 金関連取引	—
(iv) 株式関連取引	—
(v) 貴金属（金を除く）関連取引	—
(vi) その他コモディティ関連取引	—
(vii) クレジット・デリバティブ	—
一括精算ネットティング契約による 与信相当額削減効果（△）	3,115
ネットの与信相当額 (担保による信用リスク削減効果勘案前)	2,464
担保の額	—
ネットの与信相当額 (担保による信用リスク削減効果勘案後)	2,464

【訂 正 後】

(単位：百万円)

	平成 23 年 9 月末
グロス再構築コストの額	492
グロスのアドオンの額	6,969
グロスの与信相当額	7,461
(i) 外国為替関連取引	—
(ii) 金利関連取引	7,461
(iii) 金関連取引	—
(iv) 株式関連取引	—
(v) 貴金属（金を除く）関連取引	—
(vi) その他コモディティ関連取引	—
(vii) クレジット・デリバティブ	—
一括精算ネットティング契約による 与信相当額削減効果（△）	3,029
ネットの与信相当額 (担保による信用リスク削減効果勘案前)	4,431

担保の額	—
ネットの与信相当額 (担保による信用リスク削減効果勘案後)	<u>4,431</u>

(その他の訂正)

上記の他、＜自己資本の充実度の状況＞（42 ページから 46 ページ）に関する開示項目について番号を付す等の変更を行っております。

以上