

2023 年 1 月 30 日

各 位

株式会社大和ネクスト銀行

「2022 年 3 月期通期ディスクロージャー誌」の訂正について

「2022 年 3 月期通期ディスクロージャー誌」の掲載内容について、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しております。）

【訂正箇所】

- I. p.61「2. 信用リスクに関する事項（リスク・ウェイトのみなし計算が適用されるエクスポージャー及び証券化エクスポージャーを除く）中の「（1）エクスポージャーの期末残高及び主な内訳」、
- II. p.62「3. 信用リスク削減手法に関する事項」、
- III. p.63「5. 証券化エクスポージャーに関する事項」中の「（1）保有する証券化エクスポージャーの状況」、
- IV. p.65「9. 金利リスクに関する事項」

I.について

【訂正前】

（1）エクスポージャーの期末残高及び主な内訳

<2022年3月末>

（単位：百万円）

項 目	エクスポージャーの期末残高			
	合 計	うち有価証券	うちデリバティブ	うち3か月以上延滞 エクスポージャー
地域別合計	5,381,593	<u>953,516</u>	11,491	—
国内	<u>5,240,812</u>	<u>823,076</u>	4,727	—
海外	<u>140,781</u>	<u>130,439</u>	6,763	—
取引相手別合計	5,381,593	<u>953,516</u>	11,491	—
国・地方公共団体等	<u>5,179,062</u>	<u>788,728</u>	—	—
金融機関	<u>26,550</u>	<u>6,756</u>	11,491	—
法人	121,520	114,514	—	—
個人	106	—	—	—
その他	54,353	43,516	—	—
残存期間別合計	5,381,593	<u>953,516</u>	11,491	—
1年以下	938,959	79,999	5,845	—
1年超	862,021	<u>830,072</u>	5,645	—
期間の定めのないもの	3,580,612	43,444	—	—

【訂正後】

<2022年3月末>

(単位：百万円)

項 目	エクスポージャーの期末残高			
	合 計	うち有価証券	うちデリバティブ	うち3か月以上延滞 エクスポージャー
地域別合計	5,381,593	<u>948,515</u>	11,491	—
国内	<u>5,236,614</u>	<u>813,877</u>	4,727	—
海外	<u>144,979</u>	<u>134,637</u>	6,763	—
取引相手別合計	5,381,593	<u>948,515</u>	11,491	—
国・地方公共団体等	<u>5,179,020</u>	<u>783,685</u>	—	—
金融機関	<u>26,592</u>	<u>6,798</u>	11,491	—
法人	121,520	114,514	—	—
個人	106	—	—	—
その他	54,353	43,516	—	—
残存期間別合計	5,381,593	<u>948,515</u>	11,491	—
1年以下	938,959	79,999	5,845	—
1年超	862,021	<u>825,071</u>	5,645	—
期間の定めのないもの	3,580,612	43,444	—	—

II.について

【訂正前】

<信用リスク削減手法が適用されたエクスポージャーの額>

(単位：百万円)

信用リスク削減手法	2021年3月末	2022年3月末
適格金融資産担保	304,930	<u>310,911</u>
現金及び自行預金	304,930	<u>310,911</u>
保証、クレジット・デリバティブ	84,771	<u>97,805</u>
保証	84,771	<u>97,805</u>
クレジット・デリバティブ	—	—
合 計	389,701	<u>408,716</u>

【訂正後】

<信用リスク削減手法が適用されたエクスポージャーの額>

(単位：百万円)

信用リスク削減手法	2021年3月末	2022年3月末
適格金融資産担保	304,930	<u>308,333</u>
現金及び自行預金	304,930	<u>308,333</u>
保証、クレジット・デリバティブ	84,771	<u>99,060</u>
保証	84,771	<u>99,060</u>
クレジット・デリバティブ	—	—
合 計	389,701	<u>407,394</u>

III.について

【訂正前】

(1) 保有する証券化エクスポージャーの状況

<原資産の種類>

(単位：百万円)

原資産の種類	2021年3月末		2022年3月末	
	エクスポージャーの額		エクスポージャーの額	
		うち再証券化 エクスポージャー		うち再証券化 エクスポージャー
オートローン	80,601	—	101,262	—
リース	5,000	—	25,017	—
住宅ローン債権	133,203	—	259,165	—
事業法人向けローン	374,726	—	316,380	—
合 計	593,532	—	701,827	—

<リスク・ウエイト区分ごとの状況及び所要自己資本>

(単位：百万円)

リスク・ウエイト	2021年3月末				2022年3月末			
	エクスポージャーの額		所要自己資本の額		エクスポージャーの額		所要自己資本の額	
		うち再証券化 エクスポージャー		うち再証券化 エクスポージャー		うち再証券化 エクスポージャー		うち再証券化 エクスポージャー
20%以下	589,032	—	4,693	—	698,622	—	5,530	—
50%以下	—	—	—	—	500	—	9	—
100%以下	4,500	—	90	—	2,704	—	59	—
100%超	—	—	—	—	—	—	—	—
合 計	593,532	—	4,784	—	701,827	—	5,599	—

【訂正後】

<原資産の種類>

(単位：百万円)

原資産の種類	2021年3月末		2022年3月末	
	エクスポージャーの額		エクスポージャーの額	
		うち再証券化 エクスポージャー		うち再証券化 エクスポージャー
オートローン	80,601	—	87,516	—
リース	5,000	—	20,551	—
住宅ローン債権	133,203	—	140,976	—
事業法人向けローン	374,726	—	453,637	—
合 計	593,532	—	702,682	—

<リスク・ウエイト区分ごとの状況及び所要自己資本>

(単位：百万円)

リスク・ウエイト	2021年3月末				2022年3月末			
	エクスポージャーの額		所要自己資本の額		エクスポージャーの額		所要自己資本の額	
		うち再証券化 エクスポージャー		うち再証券化 エクスポージャー		うち再証券化 エクスポージャー		うち再証券化 エクスポージャー
20%以下	589,032	—	4,693	—	699,478	—	5,570	—
50%以下	—	—	—	—	500	—	9	—
100%以下	4,500	—	90	—	2,704	—	59	—
100%超	—	—	—	—	—	—	—	—
合 計	593,532	—	4,784	—	702,682	—	5,639	—

IV.について

【訂正前】

IRRBB1:金利リスク					
項番		イ	ロ	ハ	ニ
		△EVE		△NII	
		2022年3月末	2021年3月末	2022年3月末	2021年3月末
1	上方パラレルシフト	13,338	11,825	988	278
2	下方パラレルシフト	2,345	110	470	2,059
3	スティープ化	13,779	10,618		
4	フラット化				
5	短期金利上昇				
6	短期金利低下				
7	最大値	13,779	11,825	988	2,059
		ホ		ヘ	
		2022年3月末		2021年3月末	
8	自己資本の額	133,250		133,080	

【訂正後】

IRRBB1:金利リスク					
項番		イ	ロ	ハ	ニ
		△EVE		△NII	
		2022年3月末	2021年3月末	2022年3月末	2021年3月末
1	上方パラレルシフト	13,337	11,825	988	278
2	下方パラレルシフト	2,344	110	470	2,059
3	スティープ化	13,778	10,618		
4	フラット化				
5	短期金利上昇				
6	短期金利低下				
7	最大値	13,778	11,825	988	2,059
		ホ		ヘ	
		2022年3月末		2021年3月末	
8	自己資本の額	133,250		133,080	

以 上