

2022年4月28日

各位

東海東京フィナンシャル・ホールディングス株式会社
代表取締役社長 合田 一朗
東京都中央区日本橋二丁目5番1号
証券コード 8616 東証プライム・名証プレミア

東海東京証券の自己資本規制比率の訂正に伴う 当社決算説明資料の訂正に関するお知らせ

当社子会社である東海東京証券が過去に計算しました自己資本規制比率に誤りがあり、当社が開示しました決算説明資料の一部に訂正がありますので、お知らせいたします。

記

1. 訂正対象となる開示資料

開示資料	対象期間
決算説明資料	2022年3月期（第3、2、1四半期）、2021年3月期（各四半期）、2020年3月期（各四半期）、2019年3月期（各四半期）、2018年3月期（各四半期）、2017年3月期（第4四半期）

2. 訂正理由

東海東京証券が過去の自己資本規制比率の算出において、取引先リスク相当額のリスク認識に誤りがありました。このため過去に遡って確認したところ、上記対象期間における取引先リスク相当額に誤りがあったことから、「取引先リスク相当額」「リスク相当額」「自己資本規制比率」を訂正します。

なお、複数の資料に訂正がわたるため、訂正箇所概要および自己資本規制比率の訂正内容を記載いたします。詳細は次ページ以降をご確認ください。

精査に時間を要することから現状把握している部分を開示いたします。上記以外にも訂正を要する箇所が出てきましたら速やかに開示いたします。

2. 訂正内容

	2017年3月期	2018年3月期	2019年3月期	2020年3月期	2021年3月期				2022年3月期	
	4Q	4Q	4Q	4Q	1Q	2Q	3Q	4Q	1Q	2Q
自己資本規制比率 (%) (修正後)	<u>432.3</u>	<u>382.5</u>	<u>331.7</u>	<u>400.9</u>	<u>365.4</u>	<u>358.7</u>	<u>324.8</u>	<u>344.3</u>	<u>353.3</u>	<u>333.1</u>
自己資本規制比率 (%) (修正前)	434.3	385.6	335.5	403.2	367.4	362.1	327.1	345.2	354.4	334.4
控除後自己資本	99,931	100,250	97,493	104,165	103,734	105,500	101,954	101,603	102,033	103,367
リスク相当額(修正後)	<u>23,118</u>	<u>26,206</u>	<u>29,395</u>	<u>25,980</u>	<u>28,381</u>	<u>29,408</u>	<u>31,382</u>	<u>29,509</u>	<u>28,877</u>	<u>31,027</u>
リスク相当額(修正前)	23,006	25,995	29,056	25,831	28,231	29,131	31,161	29,431	28,788	30,910
市場リスク相当額	8,463	10,292	14,075	10,799	13,201	13,942	14,340	12,270	12,884	14,213
取引先リスク相当額 (修正後)	<u>2,015</u>	<u>2,492</u>	<u>1,897</u>	<u>1,817</u>	<u>1,936</u>	<u>2,349</u>	<u>3,928</u>	<u>4,366</u>	<u>2,950</u>	<u>3,652</u>
取引先リスク相当額 (修正前)	1,903	2,281	1,558	1,668	1,786	2,073	3,707	4,288	2,861	3,535
基礎的リスク相当額	12,639	13,421	13,422	13,363	13,243	13,115	13,113	12,872	13,042	13,161

以 上

本件に関するお問い合わせは、広報・IR部 03-3517-8618 までお願いいたします。

2022年4月28日

各位

 東海東京証券株式会社
 名古屋市中村区名駅四丁目7番1号

自己資本規制比率の訂正に関するお知らせ

当社が過去に開示いたしました自己資本規制比率の取引先リスクの認識に誤りがありました。お詫び申し上げますとともに、下記の通り訂正いたします。なお、次頁以降の訂正箇所には下線を付しております。

◆自己資本規制比率 訂正箇所概要（単位：％）

	修正前	修正後	差異
2021年9月末	334.4	333.1	▲ 1.3
2021年6月末	354.4	353.3	▲ 1.1
2021年3月末	345.2	344.3	▲ 0.9
2020年12月末	327.1	324.8	▲ 2.3
2020年9月末	362.1	358.7	▲ 3.4
2020年6月末	367.4	365.4	▲ 2.0
2020年3月末	403.2	400.9	▲ 2.3
2019年3月末	335.5	331.7	▲ 3.8
2018年3月末	385.6	382.5	▲ 3.1
2017年3月末	434.3	432.3	▲ 2.0

◆訂正対象書類

- ・当社ホームページ掲載の「業務及び財産の状況に関する説明書」（2021年3月期）
※18ページ
- ・当社ホームページ掲載の「自己資本規制比率」（2020年6月末～2021年9月末）
- ・東海東京フィナンシャル・ホールディングスホームページ掲載の「決算説明資料」（2022年3月期（第4四半期）資料で訂正）

◆2021年9月末

(単位：百万円)

		修正前	修正後	差額
基本的項目	(A)	94,481	94,481	-
補完的項目	(B)	20,739	20,739	-
	評価差額金(評価益)等	-	-	-
	金融商品取引責任準備金等	635	635	-
	一般貸倒引当金	104	104	-
	長期劣後債務	20,000	20,000	-
	短期劣後債務	-	-	-
控除資産	(C)	11,853	11,853	-
固定化されていない自己資本	(A) + (B) - (C) (D)	103,367	103,367	-
リスク相当額	(E)	30,910	31,027	117
	市場リスク相当額	14,213	14,213	-
	取引先リスク相当額	3,535	3,652	117
	基礎的リスク相当額	13,161	13,161	-
	控除前リスク相当額 (F)	30,910	31,027	117
	暗号資産等による控除額(第17条関係) (G)	-	-	-
自己資本規制比率	(D) / (E) × 100	334.4 %	333.1 %	▲ 1.3 %

◆2021年6月末

(単位：百万円)

		修正前	修正後	差額
基本的項目	(A)	92,926	92,926	-
補完的項目	(B)	20,733	20,733	-
	評価差額金(評価益)等	-	-	-
	金融商品取引責任準備金等	635	635	-
	一般貸倒引当金	98	98	-
	長期劣後債務	20,000	20,000	-
	短期劣後債務	-	-	-
控除資産	(C)	11,626	11,626	-
固定化されていない自己資本	(A) + (B) - (C) (D)	102,033	102,033	-
リスク相当額	(E)	28,788	28,877	89
	市場リスク相当額	12,884	12,884	-
	取引先リスク相当額	2,861	2,950	89
	基礎的リスク相当額	13,042	13,042	-
	控除前リスク相当額 (F)	28,788	28,877	89
	暗号資産等による控除額(第17条関係) (G)	-	-	-
自己資本規制比率	(D) / (E) × 100	354.4 %	353.3 %	▲ 1.1 %

◆2021年3月末

(単位：百万円)

		修正前	修正後	差額
基本的項目	(A)	91,699	91,699	-
補完的項目	(B)	20,736	20,736	-
	評価差額金(評価益)等	-	-	-
	金融商品取引責任準備金等	635	635	-
	一般貸倒引当金	100	100	-
	長期劣後債務	20,000	20,000	-
	短期劣後債務	-	-	-
控除資産	(C)	10,831	10,831	-
固定化されていない自己資本	(A) + (B) - (C) (D)	101,603	101,603	-
リスク相当額	(E)	29,431	29,509	78
	市場リスク相当額	12,270	12,270	-
	取引先リスク相当額	4,288	4,366	78
	基礎的リスク相当額	12,872	12,872	-
	控除前リスク相当額 (F)	29,431	29,509	78
	暗号資産等による控除額(第17条関係) (G)	-	-	-
自己資本規制比率	(D) / (E) × 100	345.2 %	344.3 %	▲ 0.9 %

◆2020年12月末

(単位：百万円)

		修正前	修正後	差額	
基本的項目	(A)	92,576	92,576	-	
補完的項目	(B)	20,605	20,605	-	
	評価差額金(評価益)等	51	51	-	
	金融商品取引責任準備金等	495	495	-	
	一般貸倒引当金	58	58	-	
	長期劣後債務	20,000	20,000	-	
	短期劣後債務	-	-	-	
控除資産	(C)	11,228	11,228	-	
固定化されていない 自己資本	(A) + (B) - (C)	(D)	101,954	101,954	-
リスク相当額	(E)	31,161	31,382	221	
	市場リスク相当額	14,340	14,340	-	
	取引先リスク相当額	3,707	3,928	221	
	基礎的リスク相当額	13,113	13,113	-	
	控除前リスク相当額	(F)	31,382	221	
	暗号資産等による控除額(第17条関係)	(G)	-	-	
自己資本規制比率	(D) / (E) × 100	327.1 %	324.8 %	▲ 2.3 %	

◆2020年9月末

(単位：百万円)

		修正前	修正後	差額	
基本的項目	(A)	96,428	96,428	-	
補完的項目	(B)	20,578	20,578	-	
	評価差額金(評価益)等	51	51	-	
	金融商品取引責任準備金等	495	495	-	
	一般貸倒引当金	31	31	-	
	長期劣後債務	20,000	20,000	-	
	短期劣後債務	-	-	-	
控除資産	(C)	11,505	11,505	-	
固定化されていない 自己資本	(A) + (B) - (C)	(D)	105,500	105,500	-
リスク相当額	(E)	29,131	29,408	277	
	市場リスク相当額	13,942	13,942	-	
	取引先リスク相当額	2,073	2,349	276	
	基礎的リスク相当額	13,115	13,115	-	
	控除前リスク相当額	(F)	29,408	277	
	暗号資産等による控除額(第17条関係)	(G)	-	-	
自己資本規制比率	(D) / (E) × 100	362.1 %	358.7 %	▲ 3.4 %	

◆2020年6月末

(単位：百万円)

		修正前	修正後	差額	
基本的項目	(A)	95,391	95,391	-	
補完的項目	(B)	20,576	20,576	-	
	評価差額金(評価益)等	51	51	-	
	金融商品取引責任準備金等	495	495	-	
	一般貸倒引当金	29	29	-	
	長期劣後債務	20,000	20,000	-	
控除資産	(C)	12,232	12,232	-	
固定化されていない 自己資本	(A) + (B) - (C)	(D)	103,734	103,734	-
リスク相当額	(E)	28,231	28,381	150	
	市場リスク相当額	13,201	13,201	-	
	取引先リスク相当額	1,786	1,936	150	
	基礎的リスク相当額	13,243	13,243	-	
自己資本規制比率	(D) / (E) × 100	367.4 %	365.4 %	▲ 2.0 %	

◆2020年3月末

(単位：百万円)

		修正前	修正後	差額
基本的項目	(A)	95,540	95,540	-
補完的項目	(B)	20,697	20,697	-
	評価差額金(評価益)等	51	51	-
	金融商品取引責任準備金等	619	619	-
	一般貸倒引当金	27	27	-
	長期劣後債務	20,000	20,000	-
控除資産	(C)	12,072	12,072	-
固定化されていない 自己資本	(A) + (B) - (C) (D)	104,165	104,165	-
リスク相当額	(E)	25,831	25,980	149
	市場リスク相当額	10,799	10,799	-
	取引先リスク相当額	1,668	1,817	149
	基礎的リスク相当額	13,363	13,363	-
自己資本規制比率	(D) / (E) × 100	403.2 %	400.9 %	▲ 2.3 %

◆2019年3月末

(単位：百万円)

		修正前	修正後	差額
基本的項目	(A)	88,686	88,686	-
補完的項目	(B)	20,617	20,617	-
	金融商品取引責任準備金等	589	589	-
	一般貸倒引当金	28	28	-
	長期劣後債務	20,000	20,000	-
控除資産	(C)	11,811	11,811	-
固定化されていない 自己資本	(A) + (B) - (C) (D)	97,493	97,493	-
リスク相当額	(E)	29,056	29,395	339
	市場リスク相当額	14,075	14,075	-
	取引先リスク相当額	1,558	1,897	339
	基礎的リスク相当額	13,422	13,422	-
自己資本規制比率	(D) / (E) × 100	335.5 %	331.7 %	▲ 3.8 %

◆2018年3月末

(単位：百万円)

		修正前	修正後	差額
基本的項目	(A)	90,387	90,387	-
補完的項目	(B)	20,627	20,627	-
	金融商品取引責任準備金等	582	582	-
	一般貸倒引当金	45	45	-
	長期劣後債務	20,000	20,000	-
控除資産	(C)	10,765	10,765	-
固定化されていない 自己資本	(A) + (B) - (C) (D)	100,250	100,250	-
リスク相当額	(E)	25,995	26,206	211
	市場リスク相当額	10,292	10,292	-
	取引先リスク相当額	2,281	2,492	211
	基礎的リスク相当額	13,421	13,421	-
自己資本規制比率	(D) / (E) × 100	385.6 %	382.5 %	▲ 3.1 %

◆2017年3月末

(単位：百万円)

		修正前	修正後	差額
基本的項目	(A)	85,754	85,754	-
補完的項目	(B)	25,476	25,476	-
	金融商品取引責任準備金等	442	442	-
	一般貸倒引当金	33	33	-
	長期劣後債務	25,000	25,000	-
控除資産	(C)	11,299	11,299	-
固定化されていない 自己資本	(A) + (B) - (C) (D)	99,931	99,931	-
リスク相当額	(E)	23,006	23,118	112
	市場リスク相当額	8,463	8,463	-
	取引先リスク相当額	1,903	2,015	112
	基礎的リスク相当額	12,639	12,639	-
自己資本規制比率	(D) / (E) × 100	434.3 %	432.3 %	▲ 2.0 %

以上

本件に関するお問い合わせは、以下までお願いいたします。
東海東京フィナンシャル・ホールディングス 広報・IR部 03-3517-8618