

2022年1月28日

各位

会社名 株式会社大和証券グループ本社  
代表者名 執行役社長 中田 誠司  
(コード番号 8601 東証・名証 (第1部))

連結流動性カバレッジ比率及び連結安定調達比率に関するお知らせ  
ー 流動性に係る経営の健全性の状況 (2021年度 第2四半期) ー

金融商品取引法第57条の17の規定に基づく大和証券グループ本社の流動性に係る経営の健全性の状況  
(2021年度 第2四半期) について下記のとおりお知らせいたします。

記

## 目次

■	主要な指標.....	3
■	定性的な開示事項.....	4
1.	連結流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項.....	4
2.	連結安定調達比率に関する定性的開示事項.....	5
■	定量的な開示事項.....	6
1.	連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項.....	6
2.	連結安定調達比率に関する定量的開示事項.....	7

■ 主要な指標

【KM1】

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号		2021年 9月末	2021年 6月末	2021年 3月末	2020年 12月末	2020年 9月末
連結流動性カバレッジ比率						
15	算入可能適格流動資産の 合計額	2,666,490	2,673,653	2,760,821	2,832,922	2,716,787
16	純資金流出額	1,709,909	1,749,312	1,712,430	1,683,954	1,639,682
17	連結流動性カバレッジ比率	155.9%	152.8%	161.2%	168.2%	165.6%
連結安定調達比率						
18	利用可能安定調達額	8,815,759				
19	所要安定調達額	5,490,069				
20	連結安定調達比率	160.5%				

## ■ 定性的な開示事項

### 1. 連結流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項

#### イ) 時系列における連結流動性カバレッジ比率の変動に関する事項

当最終指定親会社四半期の適格流動資産の合計額は前最終指定親会社四半期比 71 億 63 百万円減の 2 兆 6,664 億 90 百万円となりました。デリバティブ取引等、資金調達プログラム及び与信・流動性ファシリティに係る資金流出額が同 207 億 11 百万円減の 2,302 億 15 百万円、資金提供義務等に基づく資金流出額が同 1,106 億 61 百万円減の 1 兆 21 億 18 百万円、その他資金流入額が同 972 億 66 百万円減の 1 兆 273 億 41 百万円となり、純資金流出額は同 394 億 3 百万円減の 1 兆 7,099 億 9 百万円となりました。

その結果、連結流動性カバレッジ比率は同 3.1%増の 155.9%となり、過去 2 年間概ね安定的に推移しております。

#### ロ) 連結流動性カバレッジ比率の水準の評価に関する事項

当社グループでは、「規制流動性管理規程」を定め、法令上の最低水準を上回る水準を確保するだけでなく、社内の警戒水準を設定して十分な水準が確保されているかを定期的に評価しております。

当社グループの連結流動性カバレッジ比率は、法令上の最低水準を十分に上回っております。

#### ハ) 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項

内容に関する著しい変動はありません。

#### ニ) その他連結流動性カバレッジ比率に関する事項

開示が必要な重要事項はございません。

## 2. 連結安定調達比率に関する定性的開示事項

### イ) 時系列における連結安定調達比率の変動に関する事項

当最終指定親会社四半期の利用可能安定調達額は8兆8,157億59百万円となりました。資本の額が1兆5,382億66百万円、個人及び中小企業等からの資金調達は1兆8,472億84百万円、ホールセール資金調達の額が5兆239億75百万円となりました。

所要安定調達額は5兆4,900億69百万円となりました。貸出金又はレボ形式の取引による資産及び有価証券その他これに類するものの額が2兆8,069億74百万円、その他の資産等の額が2兆1,961億円73百万円となりました。

その結果、連結安定調達比率は160.5%となり、法令上の最低水準を十分に上回っております。

### ロ) 連結流動性比率告示第99条各号に掲げる要件を満たす場合には、その旨

該当ございません。

### ハ) その他連結安定調達比率に関する事項

開示が必要な重要事項はございません。

## ■ 定量的な開示事項

### 1. 連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

(単位：百万円、%、件)

項目		当最終指定親会社四半期		前最終指定親会社四半期	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	2,666,490		2,673,653	
<b>資金流出額 (2)</b>		資金流出率 を乗じる前 の額	資金流出率 を乗じた後 の額	資金流出率 を乗じる前 の額	資金流出率 を乗じた後 の額
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	2,070,002	207,000	2,154,268	215,426
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	2,070,002	207,000	2,154,268	215,426
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,864,118	1,489,859	2,877,908	1,498,701
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	-	-	-	-
7	うち、適格オペレーショナル預金及び負債性有価証券 以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額	2,737,248	1,362,989	2,749,720	1,370,514
8	うち、負債性有価証券の額	126,869	126,869	128,187	128,187
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	8,509,734	251,378	8,660,620	262,821
10	デリバティブ取引等、資金調達プログラム及び与信・流動性 ファンリティに係る資金流出額	230,215	230,215	250,926	250,926
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	214,487	214,487	236,122	236,122
12	うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	-	-	-	-
13	うち、与信・流動性ファンリティに係る資金流出額	15,728	15,728	14,804	14,804
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	4,690,418	1,002,118	5,380,937	1,112,779
15	偶発事象に係る資金流出額	192,728	180,953	166,164	154,039
16	資金流出合計額	3,361,524		3,494,695	
<b>資金流入額 (3)</b>		資金流入率 を乗じる前 の額	資金流入率 を乗じた後 の額	資金流入率 を乗じる前 の額	資金流入率 を乗じた後 の額
17	有担保資金運用等に係る資金流入額	6,773,080	122,603	6,600,878	119,089
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	575,069	501,669	582,138	501,686
19	その他資金流入額	4,304,214	1,027,341	4,843,419	1,124,607
20	資金流入合計額	1,651,614		1,745,383	
<b>連結流動性カバレッジ比率 (4)</b>					
21	算入可能適格流動資産の合計額	2,666,490		2,673,653	
22	純資金流出額	1,709,909		1,749,312	
23	連結流動性カバレッジ比率	155.9%		152.8%	
24	平均値計算用データ数	61		61	

## 2. 連結安定調達比率に関する定量的開示事項

(単位: 百万円、%)

項番		当最終指定親会社四半期					前最終指定親会社四半期				
		算入率考慮前金額				算入率考慮後金額	算入率考慮前金額				算入率考慮後金額
		満期なし	6月未満	6月以上1年未満	1年以上		満期なし	6月未満	6月以上1年未満	1年以上	
利用可能安定調達額 (1)											
1	資本の額	-	-	-	1,538,266	1,538,266					
2	うち、普通株式等Tier1 資本、その他Tier1 資本及びTier2資本(基準日から1年を経過する前に弁済期が到来するものを除く。)に係る基礎項目の額	-	-	-	1,538,266	1,538,266					
3	うち、上記に含まれない資本調達手段及び資本の額	-	-	-	-	-					
4	個人及び中小企業等からの資金調達	2,052,538	-	-	-	1,847,284					
5	うち、安定預金等の額	-	-	-	-	-					
6	うち、準安定預金等の額	2,052,538	-	-	-	1,847,284					
7	ホールセール資金調達	1,628,208	7,978,555	877,754	2,246,622	5,023,975					
8	うち、適格オペレーショナル預金の額	-	-	-	-	-					
9	うち、その他のホールセール資金調達の額	1,628,208	7,978,555	877,754	2,246,622	5,023,975					
10	相互に関係する資産がある負債	-	-	-	-	-					
11	その他の負債	102,959	3,608,085	101,158	604,352	406,232					
12	うち、デリバティブ負債の額	-	-	-	-	-					
13	うち、上記に含まれない負債の額	102,959	3,608,085	101,158	604,352	406,232					
14	利用可能安定調達額合計					8,815,759					
所要安定調達額 (2)											
15	流動資産の額					366,573					
16	金融機関等に預け入れているオペレーショナル預金に相当するものの額	19,415	3,917	-	-	13,624					
17	貸出金又はレポ形式の取引による資産及び有価証券その他これに類するものの額	449,101	6,300,539	617,130	1,860,179	2,806,974					
18	うち、レベル1資産を担保とする金融機関等への貸出金及びレポ形式の取引による額	-	3,807,022	10,313	3,403	57,181					
19	うち、項番18に含まれない金融機関等への貸出金及びレポ形式の取引による額	443,998	879,227	40,257	25,273	255,569					
20	うち、貸出金又はレポ形式の取引による資産の額(項番18、19及び22に該当する額を除く。)	-	1,578,747	207,023	903,964	1,501,149					
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	-	1,252,781	155,016	5	487,633					
22	うち、住宅ローン債権	-	-	-	-	-					
23	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	-	-	-	-	-					
24	うち、流動資産に該当しない有価証券その他これに類するもの	5,103	35,543	359,537	927,539	993,075					
25	相互に関係する負債がある資産	-	-	-	-	-					
26	その他の資産等	35,763	474,370	-	2,229,489	2,196,173					
27	うち、現物決済されるコモディティ(金を含む。)	-	-	-	-	-					
28	うち、デリバティブ取引等又は中央清算機関との取引に関連して預託した当初証拠金又は清算基金(連結貸借対照表に計上されないものを含む。)				233,832	198,757					
29	うち、デリバティブ資産の額				282,669	282,669					
30	うち、デリバティブ負債(変動証拠金の対価の額を減する前)の額				16,233	16,233					
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	35,763	474,370	-	1,696,755	1,698,514					
32	オフ・バランス取引				132,239	106,722					
33	所要安定調達額合計					5,490,069					
34	連結安定調達比率					160.5%					

以上