

2023年4月27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 東証プライム・名証プレミア)

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

－ 流動性に係る経営の健全性の状況（2022年度 第3四半期） －

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（2022年度 第3四半期）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
■ 定量的な開示事項.....	4
1. 連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項.....	4
2. 連結安定調達比率に関する定量的開示事項.....	5

■ 主要な指標

【KM1】

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号		2022年 12月末	2022年 9月末	2022年 6月末	2022年 3月末	2021年 12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	2,757,599	2,593,166	2,447,045	2,642,117	2,615,330
16	純資金流出額	1,974,833	1,802,474	1,733,889	1,772,313	1,797,829
17	連結流動性カバレッジ比率	139.6%	143.8%	141.1%	149.0%	145.4%
連結安定調達比率						
18	利用可能安定調達額	7,974,379	9,154,147	8,629,425	8,480,413	8,267,404
19	所要安定調達額	5,619,064	6,211,679	6,045,794	5,713,587	5,457,139
20	連結安定調達比率	141.9%	147.3%	142.7%	148.4%	151.4%

■ 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	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	2,757,599		2,593,166	
資金流出額 (2)		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	2,011,028	201,102	2,051,138	205,113
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	2,011,028	201,102	2,051,138	205,113
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,868,498	1,576,148	2,859,910	1,552,073
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	2,759,503	1,467,153	2,763,401	1,455,565
8	うち、負債性有価証券の額	108,994	108,994	96,508	96,508
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	11,557,511	353,066	10,066,148	349,842
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	522,364	510,682	370,584	368,728
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	503,207	503,207	346,972	346,972
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	19,157	7,475	23,612	21,756
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	4,525,069	1,172,798	5,090,231	1,088,379
15	偶発事象に係る資金流出額	173,557	162,624	189,579	178,581
16	資金流出合計額	3,976,423		3,742,719	
資金流入額 (3)		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	8,149,241	222,042	8,300,082	256,801
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	620,159	562,033	665,707	600,550
19	その他資金流入額	4,220,862	1,217,514	4,767,324	1,082,892
20	資金流入合計額	2,001,590		1,940,244	
連結流動性カバレッジ比率 (4)					
21	算入可能適格流動資産の合計額	2,757,599		2,593,166	
22	純資金流出額	1,974,833		1,802,474	
23	連結流動性カバレッジ比率	139.6%		143.8%	
24	平均値計算用データ数	62		62	

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	-	-	-	1,596,180	1,596,180	-	-	-	1,618,517	1,618,517
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	-	-	-	1,596,180	1,596,180	-	-	-	1,618,517	1,618,517
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	2,005,419	-	-	-	1,804,877	2,001,471	-	-	-	1,801,324
5	うち、安定預金等の額	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	うち、準安定預金等の額	2,005,419	-	-	-	1,804,877	2,001,471	-	-	-	1,801,324
7	ホールセール資金調達	1,201,973	10,169,639	541,582	2,451,626	4,112,416	1,121,737	12,101,776	553,107	2,523,776	5,232,684
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	1,201,973	10,169,639	541,582	2,451,626	4,112,416	1,121,737	12,101,776	553,107	2,523,776	5,232,684
10	相互に関係する資産がある負債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11	その他の負債	87,640	4,741,127	126,846	652,250	460,905	98,008	5,643,663	129,809	731,484	501,621
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	87,640	4,741,127	126,846	652,250	460,905	98,008	5,643,663	129,809	731,484	501,621
14	利用可能安定調達額合計	-	-	-	-	7,974,379	-	-	-	-	9,154,147
所要安定調達額(2)											
15	流動資産の額	-	-	-	-	304,827	-	-	-	-	309,744
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	32,349	4,644	-	-	20,819	53,475	5,068	-	-	31,806
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	476,277	7,892,053	683,846	1,802,548	2,703,710	519,520	7,801,891	900,871	1,856,321	3,031,754
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	-	4,733,656	13,016	4,349	36,413	-	4,603,600	12,683	3,614	159,327
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	476,277	961,372	26,852	705,405	945,401	519,520	1,173,891	38,071	697,318	981,829
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。)	-	2,134,609	211,434	457,287	927,857	-	1,984,519	278,500	451,789	980,520
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	-	1,769,936	131,298	11,610	290,972	-	1,664,373	202,517	11,612	363,244
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	0	62,416	432,544	635,507	794,039	0	39,881	571,617	703,600	910,078
25	相互に関係する負債がある資産	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
26	その他の資産等	42,185	397,697	-	2,551,018	2,504,785	42,462	483,003	-	2,776,524	2,732,808
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。)	-	-	-	247,129	210,060	-	-	-	319,379	271,472
29	うち、デリバティブ資産の額	-	-	-	517,355	517,355	-	-	-	540,574	540,574
30	うち、デリバティブ負債(変動証拠金の対価の額を減ずる前)の額	-	-	-	26,690	26,690	-	-	-	38,066	38,066
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	42,185	397,697	-	1,759,844	1,750,680	42,462	483,003	-	1,878,505	1,882,696
32	オフ・バランス取引	-	-	-	115,771	84,917	-	-	-	135,097	105,562
33	所要安定調達額合計	-	-	-	-	5,619,064	-	-	-	-	6,211,679
34	連結安定調達比率	-	-	-	-	141.9%	-	-	-	-	147.3%

以上