

2024年4月25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 荻野 明彦

(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（2023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（2023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		2023年 12月末	2023年 9月末	2023年 6月末	2023年 3月末	2022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	2,930,477	2,933,588	2,729,197	2,902,501	2,757,599
16	純資金流出額	2,229,082	2,242,910	2,077,052	2,135,355	1,974,833
17	連結流動性カバレッジ比率	131.4%	130.7%	131.3%	135.9%	139.6%
連結安定調達比率						
18	利用可能安定調達額	9,790,218	9,800,455	9,170,359	8,127,042	7,974,379
19	所要安定調達額	6,311,045	6,583,224	6,323,935	5,920,309	5,619,064
20	連結安定調達比率	155.1%	148.8%	145.0%	137.2%	141.9%

■ 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	2,930,477		2,933,588	
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	2,099,700	209,970	2,107,202	210,720
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	2,099,700	209,970	2,107,202	210,720
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	3,096,315	1,763,735	3,139,616	1,821,428
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	2,922,562	1,589,982	2,981,124	1,662,936
8	うち、負債性有価証券の額	173,752	173,752	158,491	158,491
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	12,255,800	588,128	11,980,101	514,327
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	418,081	405,486	470,556	458,582
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	392,515	392,515	446,204	446,204
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	25,566	12,971	24,352	12,378
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	6,635,694	1,178,263	6,294,022	1,161,713
15	偶発事象に係る資金流出額	86,993	75,769	108,479	97,401
16	資金流出合計額	4,221,353		4,264,173	
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	9,485,853	240,235	8,871,314	224,693
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	683,256	618,533	602,540	570,546
19	その他資金流入額	5,880,651	1,133,501	5,818,566	1,226,023
20	資金流入合計額	1,992,271		2,021,263	
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	2,930,477		2,933,588	
22	純資金流出額	2,229,082		2,242,910	
23	連結流動性カバレッジ比率	131.4%		130.7%	
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	-	-	-	1,666,572	1,666,572	-	-	-	1,684,377	1,684,377
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	-	-	-	1,666,572	1,666,572	-	-	-	1,684,377	1,684,377
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	2,115,901	-	-	-	1,904,311	2,098,234	-	-	-	1,888,410
5	うち、安定預金等の額	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	うち、準安定預金等の額	2,115,901	-	-	-	1,904,311	2,098,234	-	-	-	1,888,410
7	ホールセール資金調達	1,277,511	12,248,138	373,705	3,045,502	5,891,943	1,339,099	13,030,311	385,227	2,800,524	5,895,781
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	1,277,511	12,248,138	373,705	3,045,502	5,891,943	1,339,099	13,030,311	385,227	2,800,524	5,895,781
10	相互に関係する資産がある負債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11	その他の負債	81,808	5,166,671	10,665	568,329	327,391	80,506	6,492,577	18,828	579,408	331,885
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	81,808	5,166,671	10,665	568,329	327,391	80,506	6,492,577	18,828	579,408	331,885
14	利用可能安定調達額合計	-	-	-	-	9,790,218	-	-	-	-	9,800,455
所要安定調達額(2)											
15	流動資産の額	-	-	-	-	410,249	-	-	-	-	530,524
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	59,373	4,964	-	-	34,650	37,661	5,235	-	-	24,066
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	549,997	11,091,604	824,056	2,190,760	3,418,253	603,876	9,965,939	995,750	2,199,854	3,462,913
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	-	7,842,677	3,422	1,024	34,020	-	6,815,392	6,640	1,250	31,785
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	549,997	1,331,606	30,068	789,312	1,093,580	603,876	1,447,263	23,981	835,584	1,184,540
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。)	-	1,861,883	332,842	525,944	1,283,204	-	1,670,290	458,229	498,941	1,235,086
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	-	1,607,029	240,974	11,608	626,410	-	1,369,721	375,503	6,608	579,769
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	55,438	457,724	874,480	1,007,449	0	32,994	506,900	864,079	1,011,502
25	相互に関係する負債がある資産	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
26	その他の資産等	41,961	436,937	-	2,378,623	2,354,010	14,208	476,877	120	2,533,602	2,480,246
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。)	-	-	-	221,469	188,248	-	-	-	246,170	209,245
29	うち、デリバティブ資産の額	-	-	-	408,070	408,070	-	-	-	520,446	520,446
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	-	-	-	23,224	23,224	-	-	-	30,099	30,099
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	41,961	436,937	-	1,725,860	1,734,468	14,208	476,877	120	1,736,887	1,720,456
32	オフ・バランス取引	-	-	-	130,735	93,878	-	-	-	121,096	85,469
33	所要安定調達額合計	-	-	-	-	6,311,045	-	-	-	-	6,583,224
34	連結安定調達比率	-	-	-	-	155.1%	-	-	-	-	148.8%

以上