

2021年4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 (第一部))

## 連結流動性カバレッジ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 (2020年度 第4四半期) 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 (2020年度 第4四半期) について下記のとおりお知らせいたします。

記

## 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	2,760,821		2,832,922	
<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	2,169,136	216,913	2,003,263	206,748
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	2,169,136	216,913	2,003,263	206,748
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,956,993	1,617,742	2,657,048	1,504,326
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	2,861,814	1,522,563	2,529,079	1,372,178
8	うち、負債性有価証券の額	95,178	95,178	127,969	132,147
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	8,344,352	269,574	7,603,460	274,732
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 ファシリティに係る資金流出額	269,222	269,222	238,982	246,842
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	253,669	253,669	225,342	232,803
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・流動性ファシリティに係る資金流出額	15,553	15,553	13,640	14,039
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	5,664,248	1,029,948	5,178,789	1,087,140
15	偶発事象に係る資金流出額	147,277	135,170	141,136	129,244
16	資金流出合計額	3,538,572		3,449,034	
<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	6,675,874	159,095	5,975,193	150,395
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	559,774	480,489	526,538	471,151
19	その他資金流入額	5,181,506	1,186,557	4,685,286	1,143,532
20	資金流入合計額	1,826,142		1,765,079	
<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	2,760,821		2,832,922	
22	純資金流出額	1,712,430		1,683,954	
23	連結流動性カバレッジ比率	161.2%		168.2%	
24	平均値計算用データ数	60		63	

(単位 百万円、%)

国際様式 の 該当番号		2021年 3月末	2020年 12月末	2020年 9月末	2020年 6月末	2020年 3月末
<b>連結流動性カバレッジ比率</b>						
15	算入可能適格流動資産の 合計額	2,760,821	2,832,922	2,716,787	2,538,362	2,351,036
16	純資金流出額	1,712,430	1,683,954	1,639,682	1,401,920	1,560,663
17	連結流動性カバレッジ比率	161.2%	168.2%	165.6%	181.0%	150.6%

## 連結流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項

### 1. 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 721 億 1 百万円減の 2 兆 7,608 億 21 百万円となりました。ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額が同 1,134 億 16 百万円増の 1 兆 6,177 億 42 百万円、資金提供義務等に基づく資金流出額が同 571 億 92 百万円減の 1 兆 299 億 48 百万円、その他資金流入額が同 430 億 25 百万円増の 1 兆 1,865 億 57 百万円となり、純資金流出額は同 284 億 76 百万円増の 1 兆 7,124 億 30 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 7.0%減の 161.2%となり、過去 2 年間概ね安定的に推移しております。

### 2. 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。

### 3. 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。

### 4. 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。

## 連結流動性リスク管理に係る開示事項

### 1. 流動性に係るリスク管理の方針及び手続の概要に関する事項

当社グループは、ビジネスを継続する上で十分な流動性を効率的かつ安定的に確保することを資金調達の基本方針としております。資金部は当社グループの資金繰りを所管する部署として、環境が大きく変動した場合においても業務の継続に支障をきたすことのないよう、平時から安定的に資金を確保するよう努めています。

リスクマネジメント部は、流動性リスクを所管する部署として、短期及び長期の流動性管理指標を用いて、流動性リスクの状況をモニタリングし、日次で経営陣に報告しています。当該指標は、取締役会において、リスクアペタイト指標として設定し、定期的にその遵守状況を確認しております。

また、当社グループは、流動性リスクの状況を的確に把握し、適切な流動性リスク管理体制の整備・確立に努めておりますが、流動性リスクが顕在化した際に適切に対応できるよう、コンティンジェンシー・ファンディング・プランを策定しております。

## 2. 流動性に係るリスク管理上の指標及びその他流動性に係るリスク管理に関する事項

### (1) リスクアペタイト指標

短期指標としての連結流動性カバレッジ比率と長期指標としての長期性資金レシオを流動性に係るリスクアペタイト指標として設定し、管理・モニタリングを行っております。

#### 長期性資金レシオ

長期性資金の十分性を検証するための指標として長期性資金レシオを設定・管理・モニタリングし、1年以上の長期間に亘りストレス環境が継続した場合においても業務を継続するための態勢を確認しております。

### (2) コンティンジェンシー・ファンディング・プラン

当社グループは、流動性リスクが顕在化した場合には金融機関の経営破綻に直結するおそれがあることを認識しており、流動性危機時に適切に対応するため、コンティンジェンシー・ファンディング・プランを策定しております。同プランは、信用力の低下等の内生的要因や金融市場の混乱等の外生的要因によるストレスの逼迫度に応じた報告体制や資金調達手段の確保などの方針を定めております。また、早期警戒指標（EWI）を設けて、当社グループの流動性に関する状況をモニタリングしております。これにより当社グループは機動的に流動性を確保する態勢を整備しております。

以 上