

2022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（2021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
(2021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		2021年 12月末	2021年 9月末	2021年 6月末	2021年 3月末	2020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	2,615,330	2,666,490	2,673,653	2,760,821	2,832,922
16	純資金流出額	1,797,829	1,709,909	1,749,312	1,712,430	1,683,954
17	連結流動性カバレッジ比率	145.4%	155.9%	152.8%	161.2%	168.2%
連結安定調達比率						
18	利用可能安定調達額	8,267,404	8,815,759			
19	所要安定調達額	5,457,139	5,490,069			
20	連結安定調達比率	151.4%	160.5%			

■ 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	2,615,330		2,666,490	
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	1,974,079	203,908	2,070,002	207,000
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	1,974,079	203,908	2,070,002	207,000
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,783,694	1,490,120	2,864,118	1,489,859
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	2,678,388	1,382,535	2,737,248	1,362,989
8	うち、負債性有価証券の額	105,306	107,584	126,869	126,869
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	8,159,139	249,511	8,509,734	251,378
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	253,067	260,754	230,215	230,215
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	238,202	245,416	214,487	214,487
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	14,865	15,338	15,728	15,728
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	4,995,738	1,143,922	4,690,418	1,002,118
15	偶発事象に係る資金流出額	198,633	187,587	192,728	180,953
16	資金流出合計額	3,535,805		3,361,524	
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	6,955,265	120,067	6,773,080	122,603
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	559,606	516,332	575,069	501,669
19	その他資金流入額	4,356,250	1,101,575	4,304,214	1,027,341
20	資金流入合計額	1,737,976		1,651,614	
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	2,615,330		2,666,490	
22	純資金流出額	1,797,829		1,709,909	
23	連結流動性カバレッジ比率	145.4%		155.9%	
24	平均値計算用データ数	63		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	-	-	-	1,550,859	1,550,859	-	-	-	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	-	-	-	1,550,859	1,550,859	-	-	-	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	2,072,336	-	-	-	1,865,103	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	2,072,336	-	-	-	1,865,103	2,052,538	-	-	-	1,847,284
7	ホールセール資金調達	1,367,944	8,329,649	682,768	2,249,075	4,404,024	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	1,367,944	8,329,649	682,768	2,249,075	4,404,024	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	105,001	4,855,313	116,010	609,184	447,417	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	105,001	4,855,313	116,010	609,184	447,417	102,959	3,608,085	101,158	604,352	406,232
14	利用可能安定調達額合計	-	-	-	-	8,267,404	-	-	-	-	8,815,759
所要安定調達額 (2)											
15	流動資産の額	-	-	-	-	397,783	-	-	-	-	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	28,408	4,025	-	-	18,229	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	443,322	6,327,739	531,093	1,812,899	2,710,493	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	-	3,698,190	11,861	1,381	69,293	-	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	443,319	772,088	30,163	12,314	221,469	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。)	-	1,764,558	188,249	926,216	1,476,022	-	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	-	1,479,281	127,377	42	466,295	-	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	3	92,903	300,820	872,988	943,709	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	36,317	416,771	-	2,258,117	2,223,319	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。)	-	-	-	248,416	211,153	-	-	-	233,832	198,757
29	うち、デリバティブ資産の額	-	-	-	250,217	250,217	-	-	-	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	-	-	-	16,646	16,646	-	-	-	16,233	16,233
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	36,317	416,771	-	1,742,838	1,745,303	35,763	474,370	-	1,696,755	1,698,514
32	オフ・バランス取引	-	-	-	134,286	107,311	-	-	-	132,239	106,722
33	所要安定調達額合計	-	-	-	-	5,457,139	-	-	-	-	5,490,069
34	連結安定調達比率	-	-	-	-	151.4%	-	-	-	-	160.5%

以上