

2022年10月31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

ー 流動性に係る経営の健全性の状況（2022年度 第1四半期）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（2022年度 第1四半期）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 6月末 | 2022年 3月末 | 2021年 12月末 | 2021年 9月末 | 2021年 6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 | 2,447,045 | 2,642,117 | 2,615,330 | 2,666,490 | 2,673,653 |
| 16 | 純資金流出額 | 1,733,889 | 1,772,313 | 1,797,829 | 1,709,909 | 1,749,312 |
| 17 | 連結流動性カバレッジ比率 | 141.1% | 149.0% | 145.4% | 155.9% | 152.8% |
| 連結安定調達比率 | | | | | | |
| 18 | 利用可能安定調達額 | 8,629,425 | 8,480,413 | 8,267,404 | 8,815,759 | |
| 19 | 所要安定調達額 | 6,045,794 | 5,713,587 | 5,457,139 | 5,490,069 | |
| 20 | 連結安定調達比率 | 142.7% | 148.4% | 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 | 2,447,045 | | 2,642,117 | |
| 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 | 2,051,536 | 205,153 | 2,048,566 | 204,856 |
| 3 | うち、安定預金の額 | - | - | - | - |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 2,051,536 | 205,153 | 2,048,566 | 204,856 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 2,725,239 | 1,420,547 | 2,959,234 | 1,598,964 |
| 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 | 2,629,085 | 1,324,393 | 2,875,435 | 1,515,165 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 96,154 | 96,154 | 83,799 | 83,799 |
| 9 | 有担保資金調達等に係る資金流出額 | 10,190,337 | 283,345 | 9,355,219 | 246,124 |
| 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 | 393,847 | 393,847 | 276,720 | 276,720 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 369,620 | 369,620 | 254,869 | 254,869 |
| 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 | 24,227 | 24,227 | 21,851 | 21,851 |
| 14 | 資金提供義務等に基づく資金流出額 | 4,865,112 | 1,101,398 | 5,241,067 | 973,870 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 249,130 | 237,935 | 233,337 | 222,006 |
| 16 | 資金流出合計額 | 3,642,228 | | 3,522,543 | |
| 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 | 8,442,947 | 189,323 | 7,916,617 | 150,603 |
| 18 | 貸付金等の回収に係る資金流入額 | 617,742 | 559,817 | 603,911 | 531,743 |
| 19 | その他資金流入額 | 4,702,618 | 1,159,198 | 5,022,507 | 1,067,883 |
| 20 | 資金流入合計額 | 1,908,339 | | 1,750,230 | |
| 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 | 2,447,045 | | 2,642,117 | |
| 22 | 純資金流出額 | 1,733,889 | | 1,772,313 | |
| 23 | 連結流動性カバレッジ比率 | 141.1% | | 149.0% | |
| 24 | 平均値計算用データ数 | 61 | | 59 | |

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 | - | - | - | 1,604,576 | 1,604,576 | - | - | - | 1,554,359 | 1,554,359 |
| 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 | - | - | - | 1,604,576 | 1,604,576 | - | - | - | 1,554,359 | 1,554,359 |
| 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 | 2,053,863 | - | - | - | 1,848,477 | 2,050,772 | - | - | - | 1,845,694 |
| 5 | うち、安定預金等の額 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 6 | うち、準安定預金等の額 | 2,053,863 | - | - | - | 1,848,477 | 2,050,772 | - | - | - | 1,845,694 |
| 7 | ホールセール資金調達 | 1,232,566 | 10,299,342 | 736,016 | 2,335,564 | 4,644,821 | 1,483,147 | 9,702,086 | 512,524 | 2,214,951 | 4,589,973 |
| 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 | 1,232,566 | 10,299,342 | 736,016 | 2,335,564 | 4,644,821 | 1,483,147 | 9,702,086 | 512,524 | 2,214,951 | 4,589,973 |
| 10 | 相互に関係する資産がある負債 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 11 | その他の負債 | 101,448 | 4,645,898 | 124,031 | 774,830 | 531,550 | 103,231 | 4,288,108 | 134,537 | 673,382 | 490,385 |
| 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 | 101,448 | 4,645,898 | 124,031 | 774,830 | 531,550 | 103,231 | 4,288,108 | 134,537 | 673,382 | 490,385 |
| 14 | 利用可能安定調達額合計 | - | - | - | - | 8,629,425 | - | - | - | - | 8,480,413 |
| 所要安定調達額(2) | | | | | | | | | | | |
| 15 | 流動資産の額 | - | - | - | - | 340,964 | - | - | - | - | 362,843 |
| 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 | 60,143 | 4,783 | - | - | 34,855 | 31,554 | 4,283 | - | - | 20,060 |
| 17 | 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 | 535,072 | 7,745,986 | 759,591 | 2,007,536 | 3,075,534 | 525,374 | 6,669,349 | 645,034 | 1,945,191 | 2,898,848 |
| 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ボ形式の取引による額 | - | 4,527,923 | 11,507 | 3,231 | 153,881 | - | 4,085,150 | 18,322 | 2,736 | 109,177 |
| 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ボ形式の取引による額 | 535,072 | 884,592 | 44,057 | 21,309 | 267,184 | 520,374 | 863,378 | 42,484 | 14,731 | 254,844 |
| 20 | うち、貸出金又はレボ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。) | - | 2,271,295 | 291,471 | 1,060,475 | 1,626,181 | - | 1,674,865 | 172,661 | 995,426 | 1,504,947 |
| 21 | うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額 | - | 2,035,531 | 141,224 | 8 | 503,191 | - | 1,373,293 | 109,569 | 11 | 434,703 |
| 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 | - | 62,176 | 412,556 | 922,521 | 1,028,288 | 5,000 | 45,956 | 411,567 | 932,298 | 1,029,880 |
| 25 | 相互に関係する負債がある資産 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 26 | その他の資産等 | 41,615 | 500,359 | - | 2,525,209 | 2,483,076 | 46,317 | 462,901 | - | 2,358,868 | 2,327,257 |
| 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。) | - | - | - | 317,328 | 269,729 | - | - | - | 290,804 | 247,184 |
| 29 | うち、デリバティブ資産の額 | - | - | - | 401,049 | 401,049 | - | - | - | 297,629 | 297,629 |
| 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 | - | - | - | 33,301 | 33,301 | - | - | - | 25,048 | 25,048 |
| 31 | うち、上記に含まれない資産及び資本の額 | 41,615 | 500,359 | - | 1,773,531 | 1,778,997 | 46,317 | 462,901 | - | 1,745,387 | 1,757,396 |
| 32 | オフ・バランス取引 | - | - | - | 145,611 | 111,359 | - | - | - | 137,033 | 104,574 |
| 33 | 所要安定調達額合計 | - | - | - | - | 6,045,794 | - | - | - | - | 5,713,587 |
| 34 | 連結安定調達比率 | - | - | - | - | 142.7% | - | - | - | - | 148.4% |

以上