

2023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（2023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（2023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		2023年 6月末	2023年 3月末	2022年 12月末	2022年 9月末	2022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	2,729,197	2,902,501	2,757,599	2,593,166	2,447,045
16	純資金流出額	2,077,052	2,135,355	1,974,833	1,802,474	1,733,889
17	連結流動性カバレッジ比率	131.3%	135.9%	139.6%	143.8%	141.1%
連結安定調達比率						
18	利用可能安定調達額	9,170,359	8,127,042	7,974,379	9,154,147	8,629,425
19	所要安定調達額	6,323,935	5,920,309	5,619,064	6,211,679	6,045,794
20	連結安定調達比率	145.0%	137.2%	141.9%	147.3%	142.7%

■ 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	2,729,197		2,902,501	
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	2,001,969	200,196	1,986,334	198,633
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	2,001,969	200,196	1,986,334	198,633
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,796,692	1,621,334	2,858,222	1,668,096
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	2,623,023	1,447,665	2,708,959	1,518,833
8	うち、負債性有価証券の額	173,669	173,669	149,262	149,262
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	10,362,013	416,021	10,126,929	372,093
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	478,299	465,461	459,052	447,984
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	454,158	454,158	438,832	438,832
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	24,141	11,303	20,220	9,152
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	5,535,035	1,175,994	5,258,603	1,083,395
15	偶発事象に係る資金流出額	140,609	129,624	159,219	148,387
16	資金流出合計額	4,008,634		3,918,593	
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	7,990,846	209,825	8,249,489	207,780
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	596,037	549,998	561,585	531,003
19	その他資金流入額	5,084,197	1,171,757	4,860,509	1,044,454
20	資金流入合計額	1,931,581		1,783,238	
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	2,729,197		2,902,501	
22	純資金流出額	2,077,052		2,135,355	
23	連結流動性カバレッジ比率	131.3%		135.9%	
24	平均値計算用データ数	62		60	

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	-	-	-	1,675,086	1,675,086	-	-	-	1,597,999	1,597,999
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	-	-	-	1,675,086	1,675,086	-	-	-	1,597,999	1,597,999
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	2,108,378	-	-	-	1,897,540	1,916,602	-	-	-	1,724,942
5	うち、安定預金等の額	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	うち、準安定預金等の額	2,108,378	-	-	-	1,897,540	1,916,602	-	-	-	1,724,942
7	ホールセール資金調達	1,240,422	12,103,795	407,129	2,547,945	5,258,024	1,137,728	9,329,386	488,891	2,544,086	4,421,241
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	1,240,422	12,103,795	407,129	2,547,945	5,258,024	1,137,728	9,329,386	488,891	2,544,086	4,421,241
10	相互に関係する資産がある負債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11	その他の負債	85,470	6,410,060	31,577	699,735	339,707	88,131	5,424,644	93,632	684,070	382,858
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	85,470	6,410,060	31,577	699,735	339,707	88,131	5,424,644	93,632	684,070	382,858
14	利用可能安定調達額合計	-	-	-	-	9,170,359	-	-	-	-	8,127,042
所要安定調達額(2)											
15	流動資産の額	-	-	-	-	405,980	-	-	-	-	392,137
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	53,445	5,074	-	-	31,797	34,390	4,673	-	-	21,868
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	507,029	9,199,483	958,958	2,206,936	3,289,639	564,283	8,181,761	682,913	1,948,565	2,903,861
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	-	6,148,151	6,167	945	27,760	-	5,160,485	5,843	2,028	39,413
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	507,029	1,042,616	23,479	798,020	1,071,154	564,283	987,880	20,516	739,434	987,564
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。)	-	1,975,428	448,148	500,317	1,154,393	-	1,960,421	243,844	481,894	1,013,002
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	-	1,696,276	351,871	11,605	502,040	-	1,680,309	162,980	11,607	364,750
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	33,288	481,164	907,654	1,036,332	0	72,975	412,710	725,209	863,882
25	相互に関係する負債がある資産	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
26	その他の資産等	13,690	451,042	-	2,567,426	2,511,834	44,817	427,060	-	2,573,683	2,521,300
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。)	-	-	-	225,033	191,278	-	-	-	258,869	220,038
29	うち、デリバティブ資産の額	-	-	-	577,314	577,314	-	-	-	534,600	534,600
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	-	-	-	29,667	29,667	-	-	-	22,708	22,708
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	13,690	451,042	-	1,735,412	1,713,575	44,817	427,060	-	1,757,506	1,743,954
32	オフ・バランス取引	-	-	-	119,074	84,680	-	-	-	113,113	81,137
33	所要安定調達額合計	-	-	-	-	6,323,935	-	-	-	-	5,920,309
34	連結安定調達比率	-	-	-	-	145.0%	-	-	-	-	137.2%

以上