

2025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 代表執行役社長 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
ー 流動性に係る経営の健全性の状況 (2024年度 第3四半期) 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
(2024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		2024年 12月末	2024年 9月末	2024年 6月末	2024年 3月末	2023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	2,799,297	2,632,609	2,635,423	2,886,208	2,930,477
16	純資金流出額	1,957,762	1,926,313	2,009,218	2,134,431	2,229,082
17	連結流動性カバレッジ比率	142.9%	136.6%	131.1%	135.2%	131.4%
連結安定調達比率						
18	利用可能安定調達額	10,872,710	10,476,558	10,009,914	9,328,809	9,790,218
19	所要安定調達額	6,985,630	6,850,600	7,228,496	6,591,832	6,311,045
20	連結安定調達比率	155.6%	152.9%	138.4%	141.5%	155.1%

■ 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	2,799,297		2,632,609	
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	1,944,641	200,833	2,047,818	204,781
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	1,944,641	200,833	2,047,818	204,781
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,746,290	1,537,111	2,784,359	1,491,756
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	2,570,767	1,356,195	2,628,310	1,335,707
8	うち、負債性有価証券の額	175,523	180,916	156,048	156,048
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	14,749,548	767,803	14,012,879	759,242
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	379,627	377,314	398,724	385,907
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	341,808	351,865	375,943	375,943
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	37,819	25,449	22,781	9,964
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	7,787,057	1,543,291	7,117,972	1,432,782
15	偶発事象に係る資金流出額	74,942	64,038	75,430	64,251
16	資金流出合計額	4,490,394		4,338,722	
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	12,684,557	374,677	11,506,791	358,172
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	713,909	636,334	689,579	608,854
19	その他資金流入額	6,648,202	1,521,619	6,441,651	1,445,382
20	資金流入合計額	2,532,631		2,412,409	
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	2,799,297		2,632,609	
22	純資金流出額	1,957,762		1,926,313	
23	連結流動性カバレッジ比率	142.9%		136.6%	
24	平均値計算用データ数	63		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	-	-	-	1,839,925	1,839,925	-	-	-	1,721,302	1,721,302
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	-	-	-	1,839,925	1,839,925	-	-	-	1,721,302	1,721,302
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	2,058,224	-	-	-	1,852,402	2,006,183	-	-	-	1,805,564
5	うち、安定預金等の額	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	うち、準安定預金等の額	2,058,224	-	-	-	1,852,402	2,006,183	-	-	-	1,805,564
7	ホールセール資金調達	1,725,346	15,166,374	574,201	2,876,190	6,831,679	1,496,354	14,068,831	518,849	2,945,223	6,618,676
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	1,725,346	15,166,374	574,201	2,876,190	6,831,679	1,496,354	14,068,831	518,849	2,945,223	6,618,676
10	相互に関係する資産がある負債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11	その他の負債	78,551	5,896,982	25,961	695,190	348,702	77,537	4,809,048	20,637	544,026	331,014
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	78,551	5,896,982	25,961	695,190	348,702	77,537	4,809,048	20,637	544,026	331,014
14	利用可能安定調達額合計	-	-	-	-	10,872,710	-	-	-	-	10,476,558
所要安定調達額 (2)											
15	流動資産の額	-	-	-	-	579,161	-	-	-	-	519,885
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	65,160	8,569	-	-	41,149	68,540	10,704	-	-	44,975
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	554,273	13,268,339	988,331	2,369,924	3,633,572	579,280	11,498,339	1,182,228	2,317,937	3,711,460
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	-	9,861,100	10,264	3,103	39,480	-	8,131,927	88,036	2,236	78,236
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	550,999	1,558,763	68,573	887,753	1,246,491	574,848	1,675,161	32,399	817,052	1,179,111
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。)	-	1,810,895	441,040	513,940	1,262,808	-	1,644,410	665,625	546,298	1,410,598
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	-	1,555,468	305,179	26,881	607,688	-	1,374,238	550,033	21,707	724,382
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	3,274	37,581	468,454	965,128	1,084,793	4,432	46,841	396,168	952,351	1,043,515
25	相互に関係する負債がある資産	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
26	その他の資産等	45,043	481,175	-	2,670,714	2,643,894	44,933	483,237	-	2,525,855	2,486,288
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。)	-	-	-	261,606	222,365	-	-	-	247,984	210,787
29	うち、デリバティブ資産の額	-	-	-	524,197	524,197	-	-	-	397,549	397,549
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	-	-	-	25,736	25,736	-	-	-	18,414	18,414
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	45,043	481,175	-	1,859,175	1,871,596	44,933	483,237	-	1,861,908	1,859,538
32	オフ・バランス取引	-	-	-	139,970	87,848	-	-	-	121,320	87,988
33	所要安定調達額合計	-	-	-	-	6,985,630	-	-	-	-	6,850,600
34	連結安定調達比率	-	-	-	-	155.6%	-	-	-	-	152.9%

以上