

2024年10月29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
(2024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		2024年 6月末	2024年 3月末	2023年 12月末	2023年 9月末	2023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	2,635,423	2,886,208	2,930,477	2,933,588	2,729,197
16	純資金流出額	2,009,218	2,134,431	2,229,082	2,242,910	2,077,052
17	連結流動性カバレッジ比率	131.1%	135.2%	131.4%	130.7%	131.3%
連結安定調達比率						
18	利用可能安定調達額	10,009,914	9,328,809	9,790,218	9,800,455	9,170,359
19	所要安定調達額	7,228,496	6,591,832	6,311,045	6,583,224	6,323,935
20	連結安定調達比率	138.4%	141.5%	155.1%	148.8%	145.0%

■ 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	2,635,423		2,886,208	
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	2,079,806	207,980	2,115,561	211,556
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	2,079,806	207,980	2,115,561	211,556
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,975,483	1,617,575	3,117,023	1,739,456
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	2,826,291	1,468,384	2,934,919	1,557,352
8	うち、負債性有価証券の額	149,191	149,191	182,104	182,104
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	14,267,872	681,353	12,466,372	579,387
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	424,430	411,783	392,457	378,956
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	401,685	401,685	365,738	365,738
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	22,745	10,098	26,719	13,218
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	7,234,388	1,446,447	7,194,005	1,404,219
15	偶発事象に係る資金流出額	76,070	65,021	78,493	67,367
16	資金流出合計額	4,430,163		4,380,944	
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	11,759,319	292,016	10,801,366	234,894
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	776,700	667,943	703,070	637,924
19	その他資金流入額	6,687,423	1,460,984	6,458,695	1,373,694
20	資金流入合計額	2,420,944		2,246,512	
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	2,635,423		2,886,208	
22	純資金流出額	2,009,218		2,134,431	
23	連結流動性カバレッジ比率	131.1%		135.2%	
24	平均値計算用データ数	62		58	

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	-	-	-	1,754,098	1,754,098	-	-	-	1,693,385	1,693,385
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	-	-	-	1,754,098	1,754,098	-	-	-	1,693,385	1,693,385
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	2,116,456	-	-	-	1,904,810	2,089,338	-	-	-	1,880,404
5	うち、安定預金等の額	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	うち、準安定預金等の額	2,116,456	-	-	-	1,904,810	2,089,338	-	-	-	1,880,404
7	ホールセール資金調達	1,567,309	13,160,685	541,781	2,999,282	6,028,806	1,530,173	10,798,165	501,373	3,015,407	5,437,827
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	1,567,309	13,160,685	541,781	2,999,282	6,028,806	1,530,173	10,798,165	501,373	3,015,407	5,437,827
10	相互に関係する資産がある負債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11	その他の負債	86,227	6,758,938	9,192	710,450	322,198	86,334	5,726,708	11,531	620,425	317,192
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	86,227	6,758,938	9,192	710,450	322,198	86,334	5,726,708	11,531	620,425	317,192
14	利用可能安定調達額合計	-	-	-	-	10,009,914	-	-	-	-	9,328,809
所要安定調達額(2)											
15	流動資産の額	-	-	-	-	564,096	-	-	-	-	447,991
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	67,782	8,725	-	-	42,617	55,997	5,299	-	-	33,297
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	603,282	12,121,792	1,167,361	2,464,132	3,946,130	642,825	10,371,632	920,779	2,248,185	3,596,851
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	-	8,402,798	95,479	1,860	84,370	-	6,987,506	38,058	1,551	45,977
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	603,282	1,550,458	166,965	813,512	1,228,768	642,825	1,327,771	161,271	837,262	1,222,406
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。)	-	2,089,914	349,054	628,401	1,439,163	-	1,996,957	235,871	524,839	1,298,174
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	-	1,779,361	232,435	23,125	668,778	-	1,730,955	138,325	11,609	631,090
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	78,622	555,863	1,020,359	1,193,829	0	59,398	485,579	884,533	1,030,294
25	相互に関係する負債がある資産	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
26	その他の資産等	45,840	441,821	-	2,606,431	2,584,385	44,907	446,735	-	2,433,304	2,414,003
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。)	-	-	-	218,482	185,710	-	-	-	223,062	189,602
29	うち、デリバティブ資産の額	-	-	-	609,134	609,134	-	-	-	492,212	492,212
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	-	-	-	29,015	29,015	-	-	-	28,027	28,027
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	45,840	441,821	-	1,749,800	1,760,526	44,907	446,735	-	1,690,003	1,704,162
32	オフ・バランス取引	-	-	-	123,975	91,264	-	-	-	132,370	99,684
33	所要安定調達額合計	-	-	-	-	7,228,496	-	-	-	-	6,591,832
34	連結安定調達比率	-	-	-	-	138.4%	-	-	-	-	141.5%

以上