

2025年1月30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2四半期) 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2四半期) 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
■ 定性的な開示事項.....	4
1. 連結流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項.....	4
2. 連結安定調達比率に関する定性的開示事項.....	5
■ 定量的な開示事項.....	6
1. 連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項.....	6
2. 連結安定調達比率に関する定量的開示事項.....	7

■ 主要な指標

【KM1】

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号		2024年 9月末	2024年 6月末	2024年 3月末	2023年 12月末	2023年 9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	2,632,609	2,635,423	2,886,208	2,930,477	2,933,588
16	純資金流出額	1,926,313	2,009,218	2,134,431	2,229,082	2,242,910
17	連結流動性カバレッジ比率	136.6%	131.1%	135.2%	131.4%	130.7%
連結安定調達比率						
18	利用可能安定調達額	10,476,558	10,009,914	9,328,809	9,790,218	9,800,455
19	所要安定調達額	6,850,600	7,228,496	6,591,832	6,311,045	6,583,224
20	連結安定調達比率	152.9%	138.4%	141.5%	155.1%	148.8%

■ 定性的な開示事項

1. 連結流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項

イ) 時系列における連結流動性カバレッジ比率の変動に関する事項

当最終指定親会社四半期の適格流動資産の合計額は前最終指定親会社四半期比28億14百万円減の2兆6,326億9百万円となりました。ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額が同1,258億19百万円減の1兆4,917億56百万円、有担保資金調達等に係る資金流出額が同778億89百万円増の7,592億42百万円、有担保資金運用等に係る資金流入額が同661億56百万円増の3,581億72百万円、貸付金等の回収に係る資金流入額が同590億89百万円減の6,088億54百万円となり、純資金流出額は同829億5百万円減の1兆9,263億13百万円となりました。

その結果、連結流動性カバレッジ比率は同5.5%増の136.6%となり、過去2年間概ね安定的に推移しております。

ロ) 連結流動性カバレッジ比率の水準の評価に関する事項

当社グループでは、「規制流動性管理規程」を定め、法令上の最低水準を上回る水準を確保するだけでなく、社内の警戒水準を設定して十分な水準が確保されているかを定期的に評価しております。

当社グループの連結流動性カバレッジ比率は、法令上の最低水準を十分に上回っております。

ハ) 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項

内容に関する著しい変動はありません。

ニ) その他連結流動性カバレッジ比率に関する事項

開示が必要な重要事項はございません。

2. 連結安定調達比率に関する定性的開示事項

イ) 時系列における連結安定調達比率の変動に関する事項

当最終指定親会社四半期の利用可能安定調達額は前最終指定親会社四半期比 4,666 億 44 百万円増の 10 兆 4,765 億 58 百万円となりました。個人及び中小企業等からの資金調達が同 992 億 46 百万円減の 1 兆 8,055 億 64 百万円、ホールセール資金調達の額が同 5,898 億 70 百万円増の 6 兆 6,186 億 76 百万円となりました。

所要安定調達額は同 3,778 億 96 百万円減の 6 兆 8,506 億 0 百万円となりました。流動資産の額が同 442 億 11 百万円減の 5,198 億円 85 百万円、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が同 2,346 億 70 百万円減の 3 兆 7,114 億 60 百万円、その他の資産等が同 980 億 97 百万円減の 2 兆 4,862 億 88 百万円となりました。

その結果、連結安定調達比率は同 14.5%増の 152.9%となり、法令上の最低水準を十分に上回っております。

ロ) 連結流動性比率告示第 99 条各号に掲げる要件を満たす場合には、その旨

該当ございません。

ハ) その他連結安定調達比率に関する事項

開示が必要な重要事項はございません。

■ 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	2,632,609		2,635,423	
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	2,047,818	204,781	2,079,806	207,980
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	2,047,818	204,781	2,079,806	207,980
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,784,359	1,491,756	2,975,483	1,617,575
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	2,628,310	1,335,707	2,826,291	1,468,384
8	うち、負債性有価証券の額	156,048	156,048	149,191	149,191
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	14,012,879	759,242	14,267,872	681,353
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	398,724	385,907	424,430	411,783
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	375,943	375,943	401,685	401,685
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	22,781	9,964	22,745	10,098
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	7,117,972	1,432,782	7,234,388	1,446,447
15	偶発事象に係る資金流出額	75,430	64,251	76,070	65,021
16	資金流出合計額	4,338,722		4,430,163	
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	11,506,791	358,172	11,759,319	292,016
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	689,579	608,854	776,700	667,943
19	その他資金流入額	6,441,651	1,445,382	6,687,423	1,460,984
20	資金流入合計額	2,412,409		2,420,944	
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	2,632,609		2,635,423	
22	純資金流出額	1,926,313		2,009,218	
23	連結流動性カバレッジ比率	136.6%		131.1%	
24	平均値計算用データ数	62		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	-	-	-	1,721,302	1,721,302	-	-	-	1,754,098	1,754,098
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	-	-	-	1,721,302	1,721,302	-	-	-	1,754,098	1,754,098
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	2,006,183	-	-	-	1,805,564	2,116,456	-	-	-	1,904,810
5	うち、安定預金等の額	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	うち、準安定預金等の額	2,006,183	-	-	-	1,805,564	2,116,456	-	-	-	1,904,810
7	ホールセール資金調達	1,496,354	14,068,831	518,849	2,945,223	6,618,676	1,567,309	13,160,695	541,781	2,999,282	6,028,806
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	1,496,354	14,068,831	518,849	2,945,223	6,618,676	1,567,309	13,160,695	541,781	2,999,282	6,028,806
10	相互に関係する資産がある負債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11	その他の負債	77,537	4,809,048	20,637	544,026	331,014	86,227	6,758,938	9,192	710,450	322,198
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	77,537	4,809,048	20,637	544,026	331,014	86,227	6,758,938	9,192	710,450	322,198
14	利用可能安定調達額合計	-	-	-	-	10,476,558	-	-	-	-	10,009,914
所要安定調達額(2)											
15	流動資産の額	-	-	-	-	519,885	-	-	-	-	564,096
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	68,540	10,704	-	-	44,975	67,782	8,725	-	-	42,617
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	579,280	11,498,339	1,182,228	2,317,937	3,711,460	603,282	12,121,792	1,167,361	2,464,132	3,946,130
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	-	8,131,927	88,036	2,236	78,236	-	8,402,798	95,479	1,860	84,370
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	574,848	1,675,161	32,399	817,052	1,179,111	603,282	1,550,458	166,965	813,512	1,228,768
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。)	-	1,644,410	665,625	546,298	1,410,598	-	2,089,914	349,054	628,401	1,439,163
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	-	1,374,238	550,033	21,707	724,382	-	1,779,361	232,435	23,125	668,778
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	4,432	46,841	396,168	952,351	1,043,515	0	78,622	555,863	1,020,359	1,193,829
25	相互に関係する負債がある資産	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
26	その他の資産等	44,933	483,237	-	2,525,855	2,486,288	45,840	441,821	-	2,606,431	2,584,385
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。)	-	-	-	247,984	210,787	-	-	-	218,482	185,710
29	うち、デリバティブ資産の額	-	-	-	397,549	397,549	-	-	-	609,134	609,134
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	-	-	-	18,414	18,414	-	-	-	29,015	29,015
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	44,933	483,237	-	1,861,908	1,859,538	45,840	441,821	-	1,749,800	1,760,526
32	オフ・バランス取引	-	-	-	121,320	87,988	-	-	-	123,975	91,264
33	所要安定調達額合計	-	-	-	-	6,850,600	-	-	-	-	7,228,496
34	連結安定調達比率	-	-	-	-	152.9%	-	-	-	-	138.4%

以上