

2024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 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
(2023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		2023年 9月末	2023年 6月末	2023年 3月末	2022年 12月末	2022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	2,933,588	2,729,197	2,902,501	2,757,599	2,593,166
16	純資金流出額	2,242,910	2,077,052	2,135,355	1,974,833	1,802,474
17	連結流動性カバレッジ比率	130.7%	131.3%	135.9%	139.6%	143.8%
連結安定調達比率						
18	利用可能安定調達額	9,800,455	9,170,359	8,127,042	7,974,379	9,154,147
19	所要安定調達額	6,583,224	6,323,935	5,920,309	5,619,064	6,211,679
20	連結安定調達比率	148.8%	145.0%	137.2%	141.9%	147.3%

■ 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 2,043 億 91 百万円増の 2 兆 9,335 億 88 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 2,000 億 94 百万円増の 1 兆 8,214 億 28 百万円、有担保資金調達等に係る資金流出額が同 983 億 6 百万円増の 5,143 億 27 百万円、偶発事象に係る資金流出額が同 322 億 23 百万円減の 974 億 1 百万円、その他資金流入額が同 542 億 66 百万円増の 1 兆 2,260 億 23 百万円となり、純資金流出額は同 1,658 億 58 百万円増の 2 兆 2,429 億 10 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 0.6%減の 130.7%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 6,300 億 96 百万円増の 9 兆 8,004 億 55 百万円となりました。ホールセール資金調達の額が同 6,377 億 57 百万円増の 5 兆 8,957 億 81 百万円となりました。

所要安定調達額は同 2,592 億 89 百万円増の 6 兆 5,832 億 24 百万円となりました。流動資産の額が同 1,245 億 44 百万円増の 5,305 億 24 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 1,732 億 74 百万円増の 3 兆 4,629 億 13 百万円、その他の資産等の額が同 315 億 88 百万円減の 2 兆 4,802 億 46 百万円となりました。

その結果、連結安定調達比率は同 3.8%増の 148.8%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	2,933,588		2,729,197	
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	2,107,202	210,720	2,001,969	200,196
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	2,107,202	210,720	2,001,969	200,196
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	3,139,616	1,821,428	2,796,692	1,621,334
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	2,981,124	1,662,936	2,623,023	1,447,665
8	うち、負債性有価証券の額	158,491	158,491	173,669	173,669
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	11,980,101	514,327	10,362,013	416,021
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	470,556	458,582	478,299	465,461
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	446,204	446,204	454,158	454,158
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	24,352	12,378	24,141	11,303
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	6,294,022	1,161,713	5,535,035	1,175,994
15	偶発事象に係る資金流出額	108,479	97,401	140,609	129,624
16	資金流出合計額	4,264,173		4,008,634	
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	8,871,314	224,693	7,990,846	209,825
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	602,540	570,546	596,037	549,998
19	その他資金流入額	5,818,566	1,226,023	5,084,197	1,171,757
20	資金流入合計額	2,021,263		1,931,581	
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	2,933,588		2,729,197	
22	純資金流出額	2,242,910		2,077,052	
23	連結流動性カバレッジ比率	130.7%		131.3%	
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	-	-	-	1,684,377	1,684,377	-	-	-	1,675,086	1,675,086
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	-	-	-	1,684,377	1,684,377	-	-	-	1,675,086	1,675,086
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	2,098,234	-	-	-	1,888,410	2,108,378	-	-	-	1,897,540
5	うち、安定預金等の額	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	うち、準安定預金等の額	2,098,234	-	-	-	1,888,410	2,108,378	-	-	-	1,897,540
7	ホールセール資金調達	1,339,099	13,030,311	385,227	2,800,524	5,895,781	1,240,422	12,103,795	407,129	2,547,945	5,258,024
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	1,339,099	13,030,311	385,227	2,800,524	5,895,781	1,240,422	12,103,795	407,129	2,547,945	5,258,024
10	相互に関係する資産がある負債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11	その他の負債	80,506	6,492,577	18,828	579,408	331,885	85,470	6,410,060	31,577	699,735	339,707
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	80,506	6,492,577	18,828	579,408	331,885	85,470	6,410,060	31,577	699,735	339,707
14	利用可能安定調達額合計	-	-	-	-	9,800,455	-	-	-	-	9,170,359
所要安定調達額(2)											
15	流動資産の額	-	-	-	-	530,524	-	-	-	-	405,980
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	37,661	5,235	-	-	24,066	53,445	5,074	-	-	31,797
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	603,876	9,965,939	995,750	2,199,854	3,462,913	507,029	9,199,483	958,958	2,206,936	3,289,639
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	-	6,815,392	6,640	1,250	31,785	-	6,148,151	6,167	945	27,760
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	603,876	1,447,263	23,981	835,584	1,184,540	507,029	1,042,616	23,479	798,020	1,071,154
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。)	-	1,670,290	458,229	498,941	1,235,086	-	1,975,428	448,148	500,317	1,154,393
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	-	1,369,721	375,503	6,608	579,769	-	1,696,276	351,871	11,605	502,040
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	32,994	506,900	864,079	1,011,502	0	33,288	481,164	907,654	1,036,332
25	相互に関係する負債がある資産	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
26	その他の資産等	14,208	476,877	120	2,533,602	2,480,246	13,690	451,042	-	2,567,426	2,511,834
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。)	-	-	-	246,170	209,245	-	-	-	225,033	191,278
29	うち、デリバティブ資産の額	-	-	-	520,446	520,446	-	-	-	577,314	577,314
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	-	-	-	30,099	30,099	-	-	-	29,667	29,667
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	14,208	476,877	120	1,736,887	1,720,456	13,690	451,042	-	1,735,412	1,713,575
32	オフ・バランス取引	-	-	-	121,096	85,469	-	-	-	119,074	84,680
33	所要安定調達額合計	-	-	-	-	6,583,224	-	-	-	-	6,323,935
34	連結安定調達比率	-	-	-	-	148.8%	-	-	-	-	145.0%

以上