

2025 年 10 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 (2025 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
(2025 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		2025年 6月末	2025年 3月末	2024年 12月末	2024年 9月末	2024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	2,642,797	2,815,464	2,799,297	2,632,609	2,635,423
16	純資金流出額	1,908,731	1,970,118	1,957,762	1,926,313	2,009,218
17	連結流動性カバレッジ比率	138.4%	142.9%	142.9%	136.6%	131.1%
連結安定調達比率						
18	利用可能安定調達額	10,546,437	10,617,314	10,872,710	10,476,558	10,009,914
19	所要安定調達額	6,912,565	6,687,791	6,985,630	6,850,600	7,228,496
20	連結安定調達比率	152.5%	158.7%	155.6%	152.9%	138.4%

■ 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	2,642,797		2,815,464	
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	1,948,080	194,808	2,005,755	200,575
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	1,948,080	194,808	2,005,755	200,575
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,845,287	1,516,657	2,812,765	1,498,963
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	2,660,560	1,331,930	2,644,437	1,330,635
8	うち、負債性有価証券の額	184,727	184,727	168,328	168,328
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	14,180,874	763,217	15,379,596	708,947
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 ファシリティに係る資金流出額	346,762	334,005	401,284	387,896
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	304,518	304,518	358,797	358,797
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・流動性ファシリティに係る資金流出額	42,244	29,487	42,487	29,099
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	7,595,337	1,620,471	7,696,666	1,615,841
15	偶発事象に係る資金流出額	75,270	63,995	75,676	64,379
16	資金流出合計額		4,493,156		4,476,604
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	11,243,978	372,325	12,750,186	345,729
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	691,545	591,240	669,663	613,131
19	その他資金流入額	6,990,275	1,620,858	6,941,302	1,547,624
20	資金流入合計額		2,584,424		2,506,486
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		2,642,797		2,815,464
22	純資金流出額		1,908,731		1,970,118
23	連結流動性カバレッジ比率		138.4%		142.9%
24	平均値計算用データ数		62		57

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	-	-	-	1,823,001	1,823,001	-	-	-	1,808,687	1,808,687
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	-	-	-	1,823,001	1,823,001	-	-	-	1,808,687	1,808,687
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	1,978,901	-	-	-	1,781,011	1,972,634	-	-	-	1,775,371
5	うち、安定預金等の額	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	うち、準安定預金等の額	1,978,901	-	-	-	1,781,011	1,972,634	-	-	-	1,775,371
7	ホールセール資金調達	1,568,269	14,466,234	805,867	2,924,482	6,623,999	1,697,942	14,002,089	742,344	2,950,219	6,699,895
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	1,568,269	14,466,234	805,867	2,924,482	6,623,999	1,697,942	14,002,089	742,344	2,950,219	6,699,895
10	相互に関係する資産がある負債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11	その他の負債	76,930	5,279,951	28,431	574,346	318,424	79,141	5,757,625	18,543	530,302	333,360
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	76,930	5,279,951	28,431	574,346	318,424	79,141	5,757,625	18,543	530,302	333,360
14	利用可能安定調達額合計	-	-	-	-	10,546,437	-	-	-	-	10,617,314
所要安定調達額（2）											
15	流動資産の額	-	-	-	-	625,956	-	-	-	-	432,744
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	42,825	10,860	-	-	26,843	39,575	11,214	-	-	25,394
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	517,586	12,033,536	957,909	2,521,799	3,696,132	634,349	13,207,335	823,106	2,382,033	3,698,949
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	-	9,200,172	33,545	1,275	39,047	-	10,129,137	6,662	2,718	46,811
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	515,568	1,593,760	57,726	731,669	1,083,698	632,765	1,586,449	55,763	771,822	1,138,607
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。）	-	1,216,671	342,654	576,761	1,258,963	-	1,474,369	281,742	519,636	1,333,423
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	-	810,943	205,088	25,657	470,252	-	1,196,065	133,946	26,197	648,455
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	2,018	22,933	523,984	1,212,094	1,314,424	1,584	17,380	478,939	1,087,857	1,180,108
25	相互に関係する負債がある資産	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
26	その他の資産等	44,913	473,525	-	2,514,423	2,484,132	44,358	1,028,699	-	2,488,041	2,443,170
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。）	-	-	-	194,809	165,588	-	-	-	205,726	174,867
29	うち、デリバティブ資産の額	-	-	-	402,400	402,400	-	-	-	366,214	366,214
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	-	-	-	19,408	19,408	-	-	-	18,193	18,193
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	44,913	473,525	-	1,897,806	1,896,736	44,358	1,028,699	-	1,897,908	1,883,896
32	オフ・バランス取引	-	-	-	136,964	79,498	-	-	-	139,008	87,529
33	所要安定調達額合計	-	-	-	-	6,912,565	-	-	-	-	6,687,791
34	連結安定調達比率	-	-	-	-	152.5%	-	-	-	-	158.7%

以上