

2022 年 10 月 31 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

－ 流動性に係る経営の健全性の状況（2022 年度 第 1 四半期） －

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
(2022 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		2022年 6月末	2022年 3月末	2021年 12月末	2021年 9月末	2021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	2,447,045	2,642,117	2,615,330	2,666,490	2,673,653
16	純資金流出額	1,733,889	1,772,313	1,797,829	1,709,909	1,749,312
17	連結流動性カバレッジ比率	141.1%	149.0%	145.4%	155.9%	152.8%
連結安定調達比率						
18	利用可能安定調達額	8,629,425	8,480,413	8,267,404	8,815,759	
19	所要安定調達額	6,045,794	5,713,587	5,457,139	5,490,069	
20	連結安定調達比率	142.7%	148.4%	151.4%	160.5%	

■ 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	2,447,045		2,642,117	
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	2,051,536	205,153	2,048,566	204,856
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	2,051,536	205,153	2,048,566	204,856
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,725,239	1,420,547	2,959,234	1,598,964
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	2,629,085	1,324,393	2,875,435	1,515,165
8	うち、負債性有価証券の額	96,154	96,154	83,799	83,799
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	10,190,337	283,345	9,355,219	246,124
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	393,847	393,847	276,720	276,720
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	369,620	369,620	254,869	254,869
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	24,227	24,227	21,851	21,851
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	4,865,112	1,101,398	5,241,067	973,870
15	偶発事象に係る資金流出額	249,130	237,935	233,337	222,006
16	資金流出合計額		3,642,228		3,522,543
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	8,442,947	189,323	7,916,617	150,603
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	617,742	559,817	603,911	531,743
19	その他資金流入額	4,702,618	1,159,198	5,022,507	1,067,883
20	資金流入合計額		1,908,339		1,750,230
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		2,447,045		2,642,117
22	純資金流出額		1,733,889		1,772,313
23	連結流動性カバレッジ比率		141.1%		149.0%
24	平均値計算用データ数	61		59	

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		-	-	-	1,604,576	1,604,576	-	-	-	1,554,359	1,554,359
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		-	-	-	1,604,576	1,604,576	-	-	-	1,554,359	1,554,359
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		2,053,863	-	-	-	1,848,477	2,050,772	-	-	-	1,845,694
5	うち、安定預金等の額		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	うち、準安定預金等の額		2,053,863	-	-	-	1,848,477	2,050,772	-	-	-	1,845,694
7	ホールセール資金調達		1,232,566	10,299,342	736,016	2,335,564	4,644,821	1,483,147	9,702,086	512,524	2,214,951	4,589,973
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		1,232,566	10,299,342	736,016	2,335,564	4,644,821	1,483,147	9,702,086	512,524	2,214,951	4,589,973
10	相互に関係する資産がある負債		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11	その他の負債		101,448	4,645,898	124,031	774,830	531,550	103,231	4,288,108	134,537	673,382	490,385
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		101,448	4,645,898	124,031	774,830	531,550	103,231	4,288,108	134,537	673,382	490,385
14	利用可能安定調達額合計		-	-	-	-	8,629,425	-	-	-	-	8,480,413
所要安定調達額（2）												
15	流動資産の額		-	-	-	-	340,964	-	-	-	-	362,843
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		60,143	4,783	-	-	34,855	31,554	4,283	-	-	20,060
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		535,072	7,745,986	759,591	2,007,536	3,075,534	525,374	6,669,349	645,034	1,945,191	2,898,848
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		-	4,527,923	11,507	3,231	153,881	-	4,085,150	18,322	2,736	109,177
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		535,072	884,592	44,057	21,309	267,184	520,374	863,378	42,484	14,731	254,844
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。）		-	2,271,295	291,471	1,060,475	1,626,181	-	1,674,865	172,661	995,426	1,504,947
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額		-	2,035,531	141,224	8	503,191	-	1,373,293	109,569	11	434,703
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		-	62,176	412,556	922,521	1,028,288	5,000	45,956	411,567	932,298	1,029,880
25	相互に関係する負債がある資産		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
26	その他の資産等		41,615	500,359	-	2,525,209	2,483,076	46,317	462,901	-	2,358,868	2,327,257
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。）		-	-	-	317,328	269,729	-	-	-	290,804	247,184
29	うち、デリバティブ資産の額		-	-	-	401,049	401,049	-	-	-	297,629	297,629
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		-	-	-	33,301	33,301	-	-	-	25,048	25,048
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額		41,615	500,359	-	1,773,531	1,778,997	46,317	462,901	-	1,745,387	1,757,396
32	オフ・バランス取引		-	-	-	145,611	111,359	-	-	-	137,033	104,574
33	所要安定調達額合計		-	-	-	-	6,045,794	-	-	-	-	5,713,587
34	連結安定調達比率		-	-	-	-	142.7%	-	-	-	-	148.4%

以上