

2026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（2025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  
(2025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		2025年 9月末	2025年 6月末	2025年 3月末	2024年 12月末	2024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	2,800,581	2,642,797	2,815,464	2,799,297	2,632,609
16	純資金流出額	1,970,256	1,908,731	1,970,118	1,957,762	1,926,313
17	連結流動性カバレッジ比率	142.1%	138.4%	142.9%	142.9%	136.6%
連結安定調達比率						
18	利用可能安定調達額	11,027,326	10,546,437	10,617,314	10,872,710	10,476,558
19	所要安定調達額	7,047,254	6,912,565	6,687,791	6,985,630	6,850,600
20	連結安定調達比率	156.4%	152.5%	158.7%	155.6%	152.9%

## ■ 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 1,577 億 84 百万円増の 2 兆 8,005 億 81 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 705 億 73 百万円増の 1 兆 5,872 億 30 百万円、有担保資金調達等に係る資金流出額が同 1,004 億 82 百万円増の 8,636 億 99 百万円、資金提供義務等に基づく資金流出額が同 1,088 億 92 百万円増の 1 兆 7,293 億 63 百万円、その他資金流入額が同 1,573 億 74 百万円増の 1 兆 7,782 億 32 百万円となり、純資金流出額は同 615 億 25 百万円増の 1 兆 9,702 億 56 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 142.1% 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4,808億89百万円増の11兆273億26百万円となりました。個人及び中小企業等からの資金調達が同1,603億21百万円増の1兆9,413億32百万円、ホールセール資金調達の額が同3,256億87百万円増の6兆9,496億86百万円となりました。

所要安定調達額は同1,346億89百万円増の7兆472億54百万円となりました。流動資産の額が同772億10百万円増の7,031億円66百万円、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473億47百万円増の3兆7,434億79百万円、その他の資産等が同127億39百万円増の2兆4,968億71百万円となりました。

その結果、連結安定調達比率は同3.9%増の156.4%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	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	2,800,581		2,642,797	
<b>資金流出額 (2)</b>		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	2,080,830	208,083	1,948,080	194,808
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	2,080,830	208,083	1,948,080	194,808
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	3,026,072	1,587,230	2,845,287	1,516,657
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	2,903,819	1,464,977	2,660,560	1,331,930
8	うち、負債性有価証券の額	122,252	122,252	184,727	184,727
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	15,255,468	863,699	14,180,874	763,217
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	310,117	298,342	346,762	334,005
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	257,645	257,645	304,518	304,518
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	52,472	40,697	42,244	29,487
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	8,051,189	1,729,363	7,595,337	1,620,471
15	偶発事象に係る資金流出額	76,488	65,275	75,270	63,995
16	資金流出合計額	4,751,995		4,493,156	
<b>資金流入額 (3)</b>		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	11,948,535	416,057	11,243,978	372,325
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	670,475	587,448	691,545	591,240
19	その他資金流入額	7,197,829	1,778,232	6,990,275	1,620,858
20	資金流入合計額	2,781,738		2,584,424	
<b>連結流動性カバレッジ比率 (4)</b>					
21	算入可能適格流動資産の合計額	2,800,581		2,642,797	
22	純資金流出額	1,970,256		1,908,731	
23	連結流動性カバレッジ比率	142.1%		138.4%	
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	-	-	-	1,834,271	1,834,271	-	-	-	1,823,001	1,823,001
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	-	-	-	1,834,271	1,834,271	-	-	-	1,823,001	1,823,001
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	2,157,035	-	-	-	1,941,332	1,978,901	-	-	-	1,781,011
5	うち、安定預金等の額	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	うち、準安定預金等の額	2,157,035	-	-	-	1,941,332	1,978,901	-	-	-	1,781,011
7	ホールセール資金調達	1,779,059	14,721,349	942,343	2,726,594	6,949,686	1,568,269	14,466,234	805,867	2,924,482	6,623,999
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	1,779,059	14,721,349	942,343	2,726,594	6,949,686	1,568,269	14,466,234	805,867	2,924,482	6,623,999
10	相互に関係する資産がある負債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11	その他の負債	77,471	5,940,936	31,266	513,657	302,036	76,930	5,279,951	28,431	574,346	318,424
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	77,471	5,940,936	31,266	513,657	302,036	76,930	5,279,951	28,431	574,346	318,424
14	利用可能安定調達額合計	-	-	-	-	11,027,326	-	-	-	-	10,546,437
所要安定調達額（2）											
15	流動資産の額	-	-	-	-	703,166	-	-	-	-	625,956
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	36,630	11,166	-	-	23,898	42,825	10,860	-	-	26,843
17	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	587,301	11,843,237	1,017,083	2,612,968	3,743,479	517,586	12,033,536	957,909	2,521,799	3,696,132
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ボ形式の取引による額	-	9,012,203	127,708	4,223	97,374	-	9,200,172	33,545	1,275	39,047
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ボ形式の取引による額	586,837	1,762,822	51,346	681,606	1,066,710	515,568	1,593,760	57,726	731,669	1,083,698
20	うち、貸出金又はレボ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。）	-	1,031,933	328,915	768,585	1,316,106	-	1,216,671	342,654	576,761	1,258,963
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	-	651,669	173,467	75,562	413,014	-	810,943	205,088	25,657	470,252
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	464	36,279	509,114	1,158,554	1,263,289	2,018	22,933	523,984	1,212,094	1,314,424
25	相互に関係する負債がある資産	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
26	その他の資産等	41,810	530,882	-	2,522,958	2,496,871	44,913	473,525	-	2,514,423	2,484,132
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。）	-	-	-	219,684	186,731	-	-	-	194,809	165,588
29	うち、デリバティブ資産の額	-	-	-	370,150	370,150	-	-	-	402,400	402,400
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	-	-	-	19,633	19,633	-	-	-	19,408	19,408
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	41,810	530,882	-	1,913,491	1,920,357	44,913	473,525	-	1,897,806	1,896,736
32	オフ・バランス取引	-	-	-	147,925	79,835	-	-	-	136,964	79,498
33	所要安定調達額合計	-	-	-	-	7,047,254	-	-	-	-	6,912,565
34	連結安定調達比率	-	-	-	-	156.4%	-	-	-	-	152.5%

以上