

2026年4月27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3四半期) 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3四半期) 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 12月末	2025年 9月末	2025年 6月末	2025年 3月末	2024年 12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	3,007,888	2,800,581	2,642,797	2,815,464	2,799,297
16	純資金流出額	2,242,492	1,970,256	1,908,731	1,970,118	1,957,762
17	連結流動性カバレッジ比率	134.1%	142.1%	138.4%	142.9%	142.9%
連結安定調達比率						
18	利用可能安定調達額	11,095,340	11,027,326	10,546,437	10,617,314	10,872,710
19	所要安定調達額	7,491,052	7,047,254	6,912,565	6,687,791	6,985,630
20	連結安定調達比率	148.1%	156.4%	152.5%	158.7%	155.6%

■ 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	3,007,888		2,800,581	
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	2,220,707	222,070	2,080,830	208,083
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	2,220,707	222,070	2,080,830	208,083
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	3,100,162	1,588,641	3,026,072	1,587,230
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	2,996,532	1,485,012	2,903,819	1,464,977
8	うち、負債性有価証券の額	103,629	103,629	122,252	122,252
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	15,289,757	976,854	15,255,468	863,699
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	336,491	325,735	310,117	298,342
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	274,260	274,260	257,645	257,645
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	62,231	51,475	52,472	40,697
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	8,458,983	1,838,501	8,051,189	1,729,363
15	偶発事象に係る資金流出額	76,065	64,809	76,488	65,275
16	資金流出合計額	5,016,613		4,751,995	
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	11,361,221	446,845	11,948,535	416,057
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	581,089	544,047	670,475	587,448
19	その他資金流入額	7,351,301	1,783,229	7,197,829	1,778,232
20	資金流入合計額	2,774,121		2,781,738	
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	3,007,888		2,800,581	
22	純資金流出額	2,242,492		1,970,256	
23	連結流動性カバレッジ比率	134.1%		142.1%	
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	-	-	-	1,914,185	1,914,185	-	-	-	1,834,271	1,834,271
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	-	-	-	1,914,185	1,914,185	-	-	-	1,834,271	1,834,271
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	2,293,179	-	-	-	2,063,861	2,157,035	-	-	-	1,941,332
5	うち、安定預金等の額	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	うち、準安定預金等の額	2,293,179	-	-	-	2,063,861	2,157,035	-	-	-	1,941,332
7	ホールセール資金調達	1,856,999	15,560,698	1,004,472	2,624,949	6,816,190	1,779,059	14,721,349	942,343	2,726,594	6,949,686
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	1,856,999	15,560,698	1,004,472	2,624,949	6,816,190	1,779,059	14,721,349	942,343	2,726,594	6,949,686
10	相互に関係する資産がある負債	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11	その他の負債	77,026	6,304,821	18,412	594,483	301,103	77,471	5,940,936	31,266	513,657	302,036
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	77,026	6,304,821	18,412	594,483	301,103	77,471	5,940,936	31,266	513,657	302,036
14	利用可能安定調達額合計	-	-	-	-	11,095,340	-	-	-	-	11,027,326
所要安定調達額 (2)											
15	流動資産の額	-	-	-	-	753,601	-	-	-	-	703,166
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	60,625	11,742	-	-	36,183	36,630	11,166	-	-	23,898
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	495,615	12,338,142	982,072	2,805,067	4,019,689	587,301	11,843,237	1,017,083	2,612,968	3,743,479
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	-	8,930,446	111,801	6,627	72,595	-	9,012,203	127,708	4,223	97,374
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	494,066	1,864,293	47,484	689,190	1,074,612	586,837	1,762,822	51,346	681,606	1,066,710
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。)	-	1,523,699	345,752	827,018	1,525,213	-	1,031,933	328,915	768,585	1,316,106
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	-	1,118,883	93,489	24,844	468,311	-	651,669	173,467	75,562	413,014
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	1,549	19,704	477,035	1,282,232	1,347,269	464	36,279	509,114	1,158,554	1,263,289
25	相互に関係する負債がある資産	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
26	その他の資産等	41,921	640,710	-	2,620,519	2,598,139	41,810	530,882	-	2,522,958	2,496,871
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。)	-	-	-	235,842	200,466	-	-	-	219,684	186,731
29	うち、デリバティブ資産の額	-	-	-	385,103	385,103	-	-	-	370,150	370,150
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	-	-	-	27,406	27,406	-	-	-	19,633	19,633
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	41,921	640,710	-	1,972,168	1,985,164	41,810	530,882	-	1,913,491	1,920,357
32	オフ・バランス取引	-	-	-	157,757	83,436	-	-	-	147,925	79,835
33	所要安定調達額合計	-	-	-	-	7,491,052	-	-	-	-	7,047,254
34	連結安定調達比率	-	-	-	-	148.1%	-	-	-	-	156.4%

以上