2026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
－　流動性に係る経営の健全性の状況（2026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（2026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		2026年6月末	2026年3月末	2025年12月末	2025年9月末	2025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	3,409,556	3,078,444	3,007,888	2,800,581	2,642,797
16	純資金流出額	2,550,952	2,446,519	2,242,492	1,970,256	1,908,731
17	連結流動性カバレッジ比率	133.6%	125.8%	134.1%	142.1%	138.4%
連結安定調達比率						
18	利用可能安定調達額	10,887,272	10,515,844	11,095,340	11,027,326	10,546,437
19	所要安定調達額	9,054,852	8,589,820	7,491,052	7,047,254	6,912,565
20	連結安定調達比率	120.2%	122.4%	148.1%	156.4%	152.5%

■ 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			3,409,556		3,078,444
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		2,477,336	247,733	2,346,529	234,652
3		うち、安定預金の額	-	-	-	-
4		うち、準安定預金の額	2,477,336	247,733	2,346,529	234,652
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額		3,359,472	1,786,425	3,232,230	1,675,407
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	3,201,974	1,628,927	3,099,879	1,543,056
8		うち、負債性有価証券の額	157,498	157,498	132,350	132,350
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		13,509,303	1,275,268	15,433,395	1,154,022
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		508,919	499,859	427,917	417,600
11		うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	419,254	419,254	358,086	358,086
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	89,665	80,605	69,831	59,514
14	資金提供義務等に基づく資金流出額		7,721,166	1,949,816	8,569,605	1,899,273
15	偶発事象に係る資金流出額		74,248	62,675	74,294	62,834
16	資金流出合計額			5,821,780		5,443,790
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		8,965,438	558,791	11,214,660	540,514
18	貸付金等の回収に係る資金流入額		679,077	599,502	656,128	587,052
19	その他資金流入額		7,006,866	2,112,533	7,733,376	1,869,704
20	資金流入合計額			3,270,827		2,997,270
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			3,409,556		3,078,444
22	純資金流出額			2,550,952		2,446,519
23	連結流動性カバレッジ比率			133.6%		125.8%
24	平均値計算用データ数			61		58

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	－	－	－	2,004,632	2,004,632	－	－	－	1,919,701	1,919,701
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	－	－	－	2,004,632	2,004,632	－	－	－	1,919,701	1,919,701
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	2,564,410	－	－	－	2,307,969	2,395,964	－	－	－	2,156,368
5	うち、安定預金等の額	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－
6	うち、準安定預金等の額	2,564,410	－	－	－	2,307,969	2,395,964	－	－	－	2,156,368
7	ホールセール資金調達	2,619,427	14,548,186	1,028,023	2,851,681	6,284,415	2,165,888	13,839,966	1,083,601	2,663,111	6,146,575
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	2,619,427	14,548,186	1,028,023	2,851,681	6,284,415	2,165,888	13,839,966	1,083,601	2,663,111	6,146,575
10	相互に関係する資産がある負債	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－
11	その他の負債	83,588	6,480,265	18,761	1,254,152	290,255	78,015	5,733,809	16,448	833,763	293,198
12	うち、デリバティブ負債の額				600,521					276,731	
13	うち、上記に含まれない負債の額	83,588	6,480,265	18,761	653,631	290,255	78,015	5,733,809	16,448	557,032	293,198
14	利用可能安定調達額合計					10,887,272					10,515,844
所要安定調達額（2）											
15	流動資産の額					732,726					734,987
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	56,716	12,179	－	－	34,447	43,465	11,991	－	－	27,728
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	537,067	12,071,261	1,269,861	2,955,686	4,848,324	611,146	11,506,159	1,227,579	2,996,858	4,845,206
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	－	7,345,688	371,060	16,415	244,783	－	6,873,760	390,950	5,913	201,388
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	534,025	2,354,408	55,185	592,802	1,065,517	611,146	2,321,958	44,953	660,111	1,135,231
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。）	－	2,299,035	239,412	1,039,964	2,079,790	－	2,266,914	231,209	958,489	2,034,131
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	－	1,625,749	85,731	26,960	764,923	－	1,725,585	74,475	25,001	846,364
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	3,042	72,130	604,204	1,306,505	1,458,234	0	43,527	560,467	1,372,345	1,474,456
25	相互に関係する負債がある資産	－	－	－	－	－	－	－	－	－	－
26	その他の資産等	40,615	787,963	－	3,557,519	3,361,376	41,747	427,350	－	3,031,833	2,902,321
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。）				1,375,971	1,169,575				947,926	805,737
29	うち、デリバティブ資産の額				－	－				－	－
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				93,308	93,308				67,072	67,072
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	40,615	787,963	－	2,088,240	2,098,493	41,747	427,350	－	2,016,835	2,029,512
32	オフ・バランス取引				174,676	77,974				169,548	79,573
33	所要安定調達額合計					9,054,852					8,589,820
34	連結安定調達比率					120.2%					122.4%

以　上