

平成27年8月17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 日比野 隆司  
(コード番号 8601 東証・名証(第一部))

## 連結流動性カバレッジ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（平成27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（平成27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

## 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	
<b>適格流動資産 (1)</b>			
1	適格流動資産の合計額	1,910,271	
<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
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	1,778,868	177,886
3	うち、安定預金の額	-	-
4	うち、準安定預金の額	1,778,868	177,886
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,444,619	734,019
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	1,273,172	562,571
8	うち、負債性有価証券の額	171,447	171,447
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	10,192,089	776,454
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	321,518	321,518
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	311,033	311,033
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	10,485	10,485
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	6,277,149	1,160,623
15	偶発事象に係る資金流出額	128,889	128,373
16	資金流出合計額		3,298,876
<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
17	有担保資金運用等に係る資金流入額	8,205,244	60,106
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	419,624	419,255
19	その他資金流入額	5,894,716	1,209,657
20	資金流入合計額		1,689,019
<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		1,910,271
22	純資金流出額		1,609,856
23	連結流動性カバレッジ比率		118.6 %
24	平均値計算用データ数		3 件

以上