

平成 27 年 11 月 16 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 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 (平成 27 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

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	2,025,224		1,910,271	
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	1,770,903	177,090	1,778,868	177,886
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	1,770,903	177,090	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	1,510,093	747,714	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	1,360,130	597,751	1,273,172	562,571
8	うち、負債性有価証券の額	149,962	149,962	171,447	171,447
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	8,257,976	582,837	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	336,061	336,061	321,518	321,518
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	325,516	325,516	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	10,544	10,544	10,485	10,485
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	4,964,298	854,806	6,277,149	1,160,623
15	偶発事象に係る資金流出額	136,278	135,770	128,889	128,373
16	資金流出合計額	2,834,280		3,298,876	
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	6,589,664	155,669	8,205,244	60,106
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	461,863	460,657	419,624	419,255
19	その他資金流入額	5,090,382	894,883	5,894,716	1,209,657
20	資金流入合計額	1,511,210		1,689,019	
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	2,025,224		1,910,271	
22	純資金流出額	1,323,069		1,609,856	
23	連結流動性カバレッジ比率	153.0 %		118.6 %	
24	平均値計算用データ数	3 件		3 件	

連結流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項

1. 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 1,149 億 53 百万円増の 2兆252億24百万円となりました。有担保資金調達等に係る資金流出額が同1,936億17百万円減の5,828億37百万円、資金提供義務に基づく資金流出額等が同3,058億17百万円減の8,548億6百万円、その他資金流入額が同3,147億74百万円減の8,948億83百万円となり、純資金流出額は同2,867億87百万円減の1兆3,230億69百万円となりました。

その結果、連結流動性カバレッジ比率は同34.4ポイント増の153.0%となりました。

2. 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。

3. 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。

4. 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。

以 上