

平成28年2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 (平成27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

(注) 平成28年3月2日付で「有担保資金調達等に係る資金流出額」、及び「その他資金流入額」等を修正しております。

## 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	2,120,214		2,025,224	
<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	1,808,518	180,851	1,770,903	177,090
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	1,808,518	180,851	1,770,903	177,090
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,503,951	702,453	1,510,093	747,714
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	1,330,424	528,925	1,360,130	597,751
8	うち、負債性有価証券の額	173,527	173,527	149,962	149,962
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	8,603,307	488,221	8,257,976	582,837
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	308,747	308,747	336,061	336,061
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	298,084	298,084	325,516	325,516
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	10,663	10,663	10,544	10,544
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	5,607,674	1,018,803	4,964,298	854,806
15	偶発事象に係る資金流出額	150,250	149,743	136,278	135,770
16	資金流出合計額	2,848,821		2,834,280	
<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	5,969,088	121,662	6,589,664	155,669
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	422,258	421,053	461,863	460,657
19	その他資金流入額	5,784,576	1,032,208	5,090,382	894,883
20	資金流入合計額	1,574,924		1,511,210	
<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	2,120,214		2,025,224	
22	純資金流出額	1,273,897		1,323,069	
23	連結流動性カバレッジ比率	166.4 %		153.0 %	
24	平均値計算用データ数	3 件		3 件	

以上