

平成28年8月10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28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28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		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	2,230,981		2,034,543	
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	1,653,216	165,321	1,745,930	174,593
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	1,653,216	165,321	1,745,930	174,593
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,783,300	986,004	1,511,475	729,428
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	1,724,276	926,980	1,391,770	609,724
8	うち、負債性有価証券の額	59,024	59,024	119,704	119,704
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	6,705,027	369,113	7,445,052	429,652
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	299,207	299,207	361,879	361,879
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	288,396	288,396	351,055	351,055
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	10,811	10,811	10,823	10,823
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	6,476,919	983,665	5,354,435	983,370
15	偶発事象に係る資金流出額	152,492	152,022	164,856	164,363
16	資金流出合計額	2,955,335		2,843,287	
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	4,902,222	148,082	4,927,749	134,707
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	408,871	408,342	352,963	351,658
19	その他資金流入額	5,593,306	1,053,117	5,594,446	1,054,471
20	資金流入合計額	1,609,542		1,540,838	
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	2,230,981		2,034,543	
22	純資金流出額	1,345,793		1,302,449	
23	連結流動性カバレッジ比率	165.7 %		156.2 %	
24	平均値計算用データ数	3 件		3 件	

以上