

平成 29 年 2 月 8 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 1 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 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 28 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

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 | 2,317,653 | | 2,428,246 | |
| 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 | 1,600,131 | 160,013 | 1,576,006 | 157,600 |
| 3 | うち、安定預金の額 | - | - | - | - |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 1,600,131 | 160,013 | 1,576,006 | 157,600 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 2,020,292 | 1,151,350 | 1,954,067 | 1,139,279 |
| 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 | 1,982,432 | 1,113,490 | 1,945,034 | 1,130,247 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 37,860 | 37,860 | 9,032 | 9,032 |
| 9 | 有担保資金調達等に係る資金流出額 | 6,763,254 | 369,781 | 6,182,534 | 349,466 |
| 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 | 298,109 | 298,109 | 276,549 | 276,549 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 287,327 | 287,327 | 265,738 | 265,738 |
| 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 | 10,782 | 10,782 | 10,811 | 10,811 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 5,493,492 | 1,120,950 | 6,274,587 | 1,393,599 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 157,487 | 157,032 | 156,034 | 155,569 |
| 16 | 資金流出合計額 | 3,257,238 | | 3,472,065 | |
| 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 | 5,395,501 | 143,993 | 5,259,586 | 133,265 |
| 18 | 貸付金等の回収に係る資金流入額 | 421,603 | 420,408 | 395,095 | 394,312 |
| 19 | その他資金流入額 | 6,070,538 | 1,205,688 | 6,563,663 | 1,373,085 |
| 20 | 資金流入合計額 | 1,770,089 | | 1,900,663 | |
| 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 | 2,317,653 | | 2,428,246 | |
| 22 | 純資金流出額 | 1,487,148 | | 1,571,402 | |
| 23 | 連結流動性カバレッジ比率 | 155.8 % | | 154.5 % | |
| 24 | 平均値計算用データ数 | 3 件 | | 3 件 | |

以上