

平成30年2月7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 中田 誠司
(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29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29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	2,532,823		2,627,529	
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	1,740,436	174,043	1,650,078	165,007
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	1,740,436	174,043	1,650,078	165,007
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,316,960	1,299,461	2,419,397	1,434,417
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	2,259,509	1,242,009	2,374,010	1,389,030
8	うち、負債性有価証券の額	57,451	57,451	45,387	45,387
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	6,664,430	414,602	6,775,300	366,831
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	223,100	223,100	235,831	235,831
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	212,854	212,854	225,156	225,156
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	10,246	10,246	10,675	10,675
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	3,732,993	1,295,677	3,839,519	1,129,263
15	偶発事象に係る資金流出額	146,440	145,826	155,776	155,017
16	資金流出合計額	3,552,712		3,486,369	
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	5,586,882	156,558	5,439,234	136,276
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	429,979	428,649	395,101	394,113
19	その他資金流入額	3,490,344	1,267,433	3,517,465	1,146,987
20	資金流入合計額	1,852,641		1,677,377	
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	2,532,823		2,627,529	
22	純資金流出額	1,700,070		1,808,991	
23	連結流動性カバレッジ比率	148.9%		145.2%	
24	平均値計算用データ数	62		62	

以上