

平成 30 年 8 月 3 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 30 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 30 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	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	2,688,055		2,687,674	
<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	1,771,214	177,121	1,808,090	180,809
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	1,771,214	177,121	1,808,090	180,809
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,521,352	1,499,742	2,455,439	1,437,045
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	2,449,871	1,428,261	2,380,519	1,362,125
8	うち、負債性有価証券の額	71,481	71,481	74,919	74,919
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	5,970,161	414,006	6,438,264	419,051
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	269,545	269,545	228,464	228,464
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	259,047	259,047	217,954	217,954
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	10,498	10,498	10,510	10,510
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	4,124,606	1,245,671	3,848,840	1,328,920
15	偶発事象に係る資金流出額	156,465	156,056	150,725	150,307
16	資金流出合計額	3,762,144		3,744,602	
<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	5,105,562	170,922	6,037,256	170,172
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	486,024	451,375	408,081	406,668
19	その他資金流入額	3,836,059	1,243,618	3,587,632	1,334,882
20	資金流入合計額	1,865,916		1,911,723	
<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	2,688,055		2,687,674	
22	純資金流出額	1,896,228		1,832,879	
23	連結流動性カバレッジ比率	141.7%		146.6%	
24	平均値計算用データ数	62		59	

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号		平成30年 6月末	平成30年 3月末	平成29年 12月末	平成29年 9月末	平成29年 6月末
<b>連結流動性カバレッジ比率</b>						
15	参入可能適格流動資産 の合計額	2,688,055	2,687,674	2,532,823	2,627,529	2,499,543
16	純資金流出額	1,896,228	1,832,879	1,700,070	1,808,991	1,714,293
17	連結流動性カバレッジ比率	141.7%	146.6%	148.9%	145.2%	145.8%

以上