

2019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 (2018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 (2018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	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	2,501,861		2,675,608	
<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	1,791,902	179,190	1,785,663	178,566
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	1,791,902	179,190	1,785,663	178,566
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,393,304	1,276,488	2,700,096	1,627,673
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	2,328,102	1,211,285	2,624,593	1,552,169
8	うち、負債性有価証券の額	65,202	65,202	75,503	75,503
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	7,327,300	416,314	6,281,435	374,821
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	265,317	265,317	258,943	258,943
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	254,782	254,782	248,436	248,436
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	10,535	10,535	10,507	10,507
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	4,357,483	1,202,602	3,853,985	1,118,592
15	偶発事象に係る資金流出額	174,789	174,399	179,948	179,543
16	資金流出合計額	3,514,313		3,738,141	
<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	5,949,504	155,634	5,213,268	166,450
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	376,708	353,289	621,845	518,503
19	その他資金流入額	3,980,981	1,197,075	3,603,673	1,170,069
20	資金流入合計額	1,705,999		1,855,024	
<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	2,501,861		2,675,608	
22	純資金流出額	1,808,314		1,883,117	
23	連結流動性カバレッジ比率	138.3%		142.0%	
24	平均値計算用データ数	62		62	

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号		2018年 12月末	2018年 9月末	2018年 6月末	2018年 3月末	2017年 12月末
連結流動性カバレッジ比率						
15	算入可能適格流動性資産 の合計額	2,501,861	2,675,608	2,688,055	2,687,674	2,532,823
16	純資金流出額	1,808,314	1,883,117	1,896,228	1,832,879	1,700,070
17	連結流動性カバレッジ比率	138.3%	142.0%	141.7%	146.6%	148.9%

以上