

平成28年6月29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27年度 第4四半期) 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27年度 第4四半期) について下記のとおりお知らせいたします。

記

<お問い合わせ先>

大和証券グループ本社 広報部 鈴木・青山・木下・大橋・桑原 (Tel. 03-5555-1165)

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	2,034,543		2,120,214	
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	1,745,930	174,593	1,808,518	180,851
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	1,745,930	174,593	1,808,518	180,851
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,511,475	729,428	1,503,951	702,453
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	1,391,770	609,724	1,330,424	528,925
8	うち、負債性有価証券の額	119,704	119,704	173,527	173,527
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	7,445,052	429,652	8,603,307	488,221
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	361,879	361,879	308,747	308,747
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	351,055	351,055	298,084	298,084
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	10,823	10,823	10,663	10,663
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	5,354,435	983,370	5,607,674	1,018,803
15	偶発事象に係る資金流出額	164,856	164,363	150,250	149,743
16	資金流出合計額	2,843,287		2,848,821	
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	4,927,749	134,707	5,969,088	121,662
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	352,963	351,658	422,258	421,053
19	その他資金流入額	5,594,446	1,054,471	5,784,576	1,032,208
20	資金流入合計額	1,540,838		1,574,924	
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	2,034,543		2,120,214	
22	純資金流出額	1,302,449		1,273,897	
23	連結流動性カバレッジ比率	156.2 %		166.4 %	
24	平均値計算用データ数	3 件		3 件	

連結流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項

1. 時系列における連結流動性カバレッジ比率の変動に関する事項

当最終指定親会社四半期の適格流動資産の合計額は前最終指定親会社四半期比 856 億 71 百万円減の 2 兆 345 億 43 百万円となりました。有担保資金調達等に係る資金流出額が同 585 億 69 百万円減の 4,296 億 52 百万円、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が同 531 億 32 百万円増の 3,618 億 79 百万円、貸付金等の回収に係る資金流入額が同 693 億 95 百万円減の 3,516 億 58 百万円となり、純資金流出額は同 285 億 52 百万円増の 1 兆 3,024 億 49 百万円となりました。

その結果、連結流動性カバレッジ比率は同 10.2 ポイント減の 156.2%となりました。

2. 連結流動性カバレッジ比率の水準の評価に関する事項

当社グループでは、「規制流動性管理規程」を定め、法令上の最低水準を上回る水準を確保するだけでなく、社内の警戒水準を設定して十分な水準が確保されているかを定期的に評価しております。

当社グループの連結流動性カバレッジ比率は、法令上の最低水準を十分に上回っております。

3. 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項

内容に関する著しい変動はありません。

4. その他連結流動性カバレッジ比率に関する事項

開示が必要な重要事項はございません。

連結流動性リスク管理に係る開示事項

1. 流動性に係るリスク管理の方針及び手続の概要に関する事項

当社グループは、ビジネスを継続するうえで十分な流動性を効率的かつ安定的に確保することを資金調達の基本方針とし、環境が大きく変動した場合においても業務の継続に支障をきたすことのないよう、平時から安定的に資金を確保するよう努めています。さらに、当社は、独自の短期及び長期流動性管理指標を用いて当社グループの流動性管理体制を構築しています。

2. 流動性に係るリスク管理上の指標に関する事項

当社は、90日以内に期日が到来する無担保調達資金及び同期間にストレスが発生した場合の資金流出見込額に対し、様々なストレスシナリオを想定したうえで、それらをカバーする流動性ポートフォリオが保持されていることを日次で確認しております。その他、1年以上の長期間に亘りストレス環境が継続することを想定した場合に、保有資産を維持するための長期性資金調達状況の十分性を計測及びモニタリングしております。

3. その他流動性に係るリスク管理に関する事項

開示が必要な重要事項はございません。

以上