

平成 28 年 11 月 11 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 28 年度 第 2 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 2 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	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	2,428,246		2,230,981	
<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	1,576,006	157,600	1,653,216	165,321
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	1,576,006	157,600	1,653,216	165,321
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,954,067	1,139,279	1,783,300	986,004
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	1,945,034	1,130,247	1,724,276	926,980
8	うち、負債性有価証券の額	9,032	9,032	59,024	59,024
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	6,182,534	349,466	6,705,027	369,113
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	276,549	276,549	299,207	299,207
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	265,738	265,738	288,396	288,396
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	10,811	10,811	10,811	10,811
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	6,274,587	1,393,599	6,476,919	983,665
15	偶発事象に係る資金流出額	156,034	155,569	152,492	152,022
16	資金流出合計額	3,472,065		2,955,335	
<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	5,259,586	133,265	4,902,222	148,082
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	395,095	394,312	408,871	408,342
19	その他資金流入額	6,563,663	1,373,085	5,593,306	1,053,117
20	資金流入合計額	1,900,663		1,609,542	
<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	2,428,246		2,230,981	
22	純資金流出額	1,571,402		1,345,793	
23	連結流動性カバレッジ比率	154.5 %		165.7 %	
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1,972億65百万円増の2兆4,282億46百万円となりました。ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額が同1,532億75百万円増の1兆1,392億79百万円、資金提供義務に基づく資金流出額等が同4,099億34百万円増の1兆3,935億99百万円、その他資金流入額が同3,199億68百万円増の1兆3,730億85百万円となり、純資金流出額は同2,256億9百万円増の1兆5,714億2百万円となりました。

その結果、連結流動性カバレッジ比率は154.5%となり、平成27年度第1四半期以降、概ね安定的に推移しております。

### 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。

以 上