

平成 29 年 11 月 10 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 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 29 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・大橋・桑原・上岡 (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	2,627,529		2,499,543	
<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	1,650,078	165,007	1,581,207	158,120
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	1,650,078	165,007	1,581,207	158,120
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,419,397	1,434,417	2,178,621	1,280,236
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	2,374,010	1,389,030	2,138,865	1,240,480
8	うち、負債性有価証券の額	45,387	45,387	39,756	39,756
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	6,775,300	366,831	6,942,826	381,617
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	235,831	235,831	249,561	249,561
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	225,156	225,156	239,020	239,020
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	10,675	10,675	10,541	10,541
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	3,839,519	1,129,263	4,150,377	1,149,996
15	偶発事象に係る資金流出額	155,776	155,017	150,844	150,077
16	資金流出合計額	3,486,369		3,369,610	
<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	5,439,234	136,276	5,298,722	142,692
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	395,101	394,113	373,983	372,268
19	その他資金流入額	3,517,465	1,146,987	3,972,195	1,140,356
20	資金流入合計額	1,677,377		1,655,317	
<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	2,627,529		2,499,543	
22	純資金流出額	1,808,991		1,714,293	
23	連結流動性カバレッジ比率	145.2%		145.8%	
24	平均値計算用データ数	62		62	

## 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 1,279 億 86 百万円増の 2 兆 6,275 億 29 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 1,541 億 81 百万円増の 1 兆 4,344 億 17 百万円、資金提供義務等に基づく資金流出額が同 207 億 33 百万円減の 1 兆 1,292 億 63 百万円、その他資金流入額が同 66 億 31 百万円増の 1 兆 1,469 億 87 百万円となり、純資金流出額は同 946 億 98 百万円増の 1 兆 8,089 億 91 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 0.6 ポイント減の 145.2%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