

2020年2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 (2019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 (2019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

<お問い合わせ先>

大和証券グループ本社 広報部 山村・青山・上岡・橋本 (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	2,356,156		2,662,299	
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	1,933,894	193,389	1,846,038	184,603
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	1,933,894	193,389	1,846,038	184,603
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,662,441	1,385,836	2,966,010	1,741,468
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	2,569,511	1,292,906	2,871,565	1,647,023
8	うち、負債性有価証券の額	92,929	92,929	94,444	94,444
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	7,265,222	376,008	6,905,590	359,524
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	244,561	244,561	216,605	216,605
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	233,592	233,592	205,920	205,920
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	10,969	10,969	10,685	10,685
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	4,995,553	948,675	4,777,297	971,231
15	偶発事象に係る資金流出額	118,893	108,102	108,680	108,100
16	資金流出合計額	3,256,574		3,581,534	
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	5,670,846	156,230	5,342,539	195,937
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	427,925	379,244	495,939	413,376
19	その他資金流入額	4,419,152	985,198	4,433,741	1,093,671
20	資金流入合計額	1,520,673		1,702,985	
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	2,356,156		2,662,299	
22	純資金流出額	1,735,901		1,878,549	
23	連結流動性カバレッジ比率	135.7%		141.7%	
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		2019年 12月末	2019年 9月末	2019年 6月末	2019年 3月末	2018年 12月末
連結流動性カバレッジ比率						
15	算入可能適格流動資産 の合計額	2,356,156	2,662,299	2,674,229	2,528,417	2,501,861
16	純資金流出額	1,735,901	1,878,549	1,835,406	1,786,074	1,808,314
17	連結流動性カバレッジ比率	135.7%	141.7%	145.7%	141.5%	138.3%

以上