

2020年8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 (2020年度 第1四半期) 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 (2020年度 第1四半期) 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	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	2,538,362		2,351,036	
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	1,949,096	194,909	2,035,827	203,582
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	1,949,096	194,909	2,035,827	203,582
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,572,204	1,387,171	2,724,293	1,453,521
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	2,454,629	1,269,596	2,622,463	1,351,691
8	うち、負債性有価証券の額	117,575	117,575	101,829	101,829
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	7,719,702	296,744	8,055,267	327,332
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	265,177	265,177	268,302	268,302
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	252,234	252,234	252,644	252,644
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	12,943	12,943	15,658	15,658
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	5,856,945	1,005,363	5,094,097	1,064,649
15	偶発事象に係る資金流出額	125,935	114,104	128,326	116,246
16	資金流出合計額	3,263,472		3,433,636	
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	5,997,373	143,051	6,329,180	167,623
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	516,507	455,509	524,299	442,871
19	その他資金流入額	5,789,737	1,262,990	4,870,526	1,264,359
20	資金流入合計額	1,861,551		1,874,854	
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	2,538,362		2,351,036	
22	純資金流出額	1,401,920		1,560,663	
23	連結流動性カバレッジ比率	181.0%		150.6%	
24	平均値計算用データ数	61		58	

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号		2020年 6月末	2020年 3月末	2019年 12月末	2019年 9月末	2019年 6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	2,538,362	2,351,036	2,356,156	2,662,299	2,674,229
16	純資金流出額	1,401,920	1,560,663	1,735,901	1,878,549	1,835,406
17	連結流動性カバレッジ比率	181.0%	150.6%	135.7%	141.7%	145.7%

以上