

2021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 (2020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 (2020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

## 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	2,832,922		2,716,787	
<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	2,003,263	206,748	1,993,739	199,373
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	2,003,263	206,748	1,993,739	199,373
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,657,048	1,504,326	2,713,263	1,505,112
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	2,529,079	1,372,178	2,585,233	1,377,082
8	うち、負債性有価証券の額	127,969	132,147	128,029	128,029
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	7,603,460	274,732	8,243,318	268,881
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	238,982	246,842	237,998	237,998
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	225,342	232,803	225,461	225,461
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	13,640	14,039	12,537	12,537
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	5,178,789	1,087,140	5,659,888	985,340
15	偶発事象に係る資金流出額	141,136	129,244	150,652	138,583
16	資金流出合計額	3,449,034		3,335,291	
<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	5,975,193	150,395	6,488,529	129,022
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	526,538	471,151	580,633	488,142
19	その他資金流入額	4,685,286	1,143,532	5,226,031	1,078,443
20	資金流入合計額	1,765,079		1,695,608	
<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	2,832,922		2,716,787	
22	純資金流出額	1,683,954		1,639,682	
23	連結流動性カバレッジ比率	168.2%		165.6%	
24	平均値計算用データ数	63		61	

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号		2020年 12月末	2020年 9月末	2020年 6月末	2020年 3月末	2019年 12月末
<b>連結流動性カバレッジ比率</b>						
15	算入可能適格流動資産の 合計額	2,832,922	2,716,787	2,538,362	2,351,036	2,356,156
16	純資金流出額	1,683,954	1,639,682	1,401,920	1,560,663	1,735,901
17	連結流動性カバレッジ比率	168.2%	165.6%	181.0%	150.6%	135.7%

以上