

2021年8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 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 (2021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 (2021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	2,673,653		2,760,821	
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	2,154,268	215,426	2,169,136	216,913
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	2,154,268	215,426	2,169,136	216,913
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,877,908	1,498,701	2,956,993	1,617,742
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	2,749,720	1,370,514	2,861,814	1,522,563
8	うち、負債性有価証券の額	128,187	128,187	95,178	95,178
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	8,660,620	262,821	8,344,352	269,574
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	250,926	250,926	269,222	269,222
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	236,122	236,122	253,669	253,669
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	14,804	14,804	15,553	15,553
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	5,380,937	1,112,779	5,664,248	1,029,948
15	偶発事象に係る資金流出額	166,164	154,039	147,277	135,170
16	資金流出合計額	3,494,695		3,538,572	
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	6,600,878	119,089	6,675,874	159,095
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	582,138	501,686	559,774	480,489
19	その他資金流入額	4,843,419	1,124,607	5,181,506	1,186,557
20	資金流入合計額	1,745,383		1,826,142	
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	2,673,653		2,760,821	
22	純資金流出額	1,749,312		1,712,430	
23	連結流動性カバレッジ比率	152.8%		161.2%	
24	平均値計算用データ数	61		60	

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号		2021年 6月末	2021年 3月末	2020年 12月末	2020年 9月末	2020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	2,673,653	2,760,821	2,832,922	2,716,787	2,538,362
16	純資金流出額	1,749,312	1,712,430	1,683,954	1,639,682	1,401,920
17	連結流動性カバレッジ比率	152.8%	161.2%	168.2%	165.6%	181.0%

以上