

平成 29 年 2 月 8 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 日比野 隆司
(コード番号 8601 東証・名証 (第 1 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 28 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 (平成 28 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 鈴木・青山・木下・大橋・桑原 (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	2,317,653		2,428,246	
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	1,600,131	160,013	1,576,006	157,600
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	1,600,131	160,013	1,576,006	157,600
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,020,292	1,151,350	1,954,067	1,139,279
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	1,982,432	1,113,490	1,945,034	1,130,247
8	うち、負債性有価証券の額	37,860	37,860	9,032	9,032
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	6,763,254	369,781	6,182,534	349,466
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	298,109	298,109	276,549	276,549
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	287,327	287,327	265,738	265,738
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	10,782	10,782	10,811	10,811
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	5,493,492	1,120,950	6,274,587	1,393,599
15	偶発事象に係る資金流出額	157,487	157,032	156,034	155,569
16	資金流出合計額	3,257,238		3,472,065	
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	5,395,501	143,993	5,259,586	133,265
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	421,603	420,408	395,095	394,312
19	その他資金流入額	6,070,538	1,205,688	6,563,663	1,373,085
20	資金流入合計額	1,770,089		1,900,663	
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	2,317,653		2,428,246	
22	純資金流出額	1,487,148		1,571,402	
23	連結流動性カバレッジ比率	155.8 %		154.5 %	
24	平均値計算用データ数	3 件		3 件	

以上