

平成29年8月9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

### － 流動性に係る経営の健全性の状況（平成29年度 第1四半期） －

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29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	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	2,499,543		2,365,828	
<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	1,581,207	158,120	1,622,463	162,246
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	1,581,207	158,120	1,622,463	162,246
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,178,621	1,280,236	2,165,766	1,265,395
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	2,138,865	1,240,480	2,143,673	1,243,302
8	うち、負債性有価証券の額	39,756	39,756	22,092	22,092
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	6,942,826	381,617	7,147,459	382,625
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	249,561	249,561	266,467	266,467
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	239,020	239,020	255,943	255,943
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	10,541	10,541	10,524	10,524
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	4,150,377	1,149,996	5,121,482	1,261,432
15	偶発事象に係る資金流出額	150,844	150,077	159,840	159,005
16	資金流出合計額	3,369,610		3,497,172	
<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	5,298,722	142,692	5,516,121	140,248
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	373,983	372,268	419,631	416,459
19	その他資金流入額	3,972,195	1,140,356	5,290,561	1,312,732
20	資金流入合計額	1,655,317		1,869,441	
<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	2,499,543		2,365,828	
22	純資金流出額	1,714,293		1,627,730	
23	連結流動性カバレッジ比率	145.8%		145.3%	
24	平均値計算用データ数	62		61	

以上