

2019年8月6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 (2019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 (2019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

<お問い合わせ先>

大和証券グループ本社 広報部 山村・青山・上岡・橋本 (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	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	2,674,229		2,528,417	
<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	1,817,535	181,753	1,757,279	175,727
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	1,817,535	181,753	1,757,279	175,727
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,700,391	1,567,008	2,646,411	1,545,852
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	2,614,324	1,480,941	2,581,951	1,481,392
8	うち、負債性有価証券の額	86,066	86,066	64,460	64,460
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	6,744,272	361,627	6,799,261	433,523
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	212,763	212,763	226,236	226,236
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	202,243	202,243	215,618	215,618
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	10,520	10,520	10,618	10,618
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	4,388,012	1,132,269	4,095,100	1,072,910
15	偶発事象に係る資金流出額	97,447	97,058	86,791	86,405
16	資金流出合計額	3,552,481		3,540,657	
<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	5,442,897	170,905	5,451,550	188,070
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	398,661	357,321	502,341	408,594
19	その他資金流入額	4,023,773	1,188,847	3,828,179	1,157,918
20	資金流入合計額	1,717,074		1,754,582	
<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	2,674,229		2,528,417	
22	純資金流出額	1,835,406		1,786,074	
23	連結流動性カバレッジ比率	145.7%		141.5%	
24	平均値計算用データ数	59		58	

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号		2019年 6月末	2019年 3月末	2018年 12月末	2018年 9月末	2018年 6月末
連結流動性カバレッジ比率						
15	算入可能適格流動性資産 の合計額	2,674,229	2,528,417	2,501,861	2,675,608	2,688,055
16	純資金流出額	1,835,406	1,786,074	1,808,314	1,883,117	1,896,228
17	連結流動性カバレッジ比率	145.7%	141.5%	138.3%	142.0%	141.7%

以上