

2020年11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2四半期) 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2四半期) 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	2,716,787		2,538,362	
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	1,993,739	199,373	1,949,096	194,909
3	うち、安定預金の額	-	-	-	-
4	うち、準安定預金の額	1,993,739	199,373	1,949,096	194,909
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,713,263	1,505,112	2,572,204	1,387,171
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	2,585,233	1,377,082	2,454,629	1,269,596
8	うち、負債性有価証券の額	128,029	128,029	117,575	117,575
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	8,243,318	268,881	7,719,702	296,744
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	237,998	237,998	265,177	265,177
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	225,461	225,461	252,234	252,234
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	12,537	12,537	12,943	12,943
14	資金提供義務等に基づく資金流出額	5,659,888	985,340	5,856,945	1,005,363
15	偶発事象に係る資金流出額	150,652	138,583	125,935	114,104
16	資金流出合計額	3,335,291		3,263,472	
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	6,488,529	129,022	5,997,373	143,051
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	580,633	488,142	516,507	455,509
19	その他資金流入額	5,226,031	1,078,443	5,789,737	1,262,990
20	資金流入合計額	1,695,608		1,861,551	
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	2,716,787		2,538,362	
22	純資金流出額	1,639,682		1,401,920	
23	連結流動性カバレッジ比率	165.6%		181.0%	
24	平均値計算用データ数	61		61	

(単位 百万円、%)

国際様式の 該当番号		2020年 9月末	2020年 6月末	2020年 3月末	2019年 12月末	2019年 9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	2,716,787	2,538,362	2,351,036	2,356,156	2,662,299
16	純資金流出額	1,639,682	1,401,920	1,560,663	1,735,901	1,878,549
17	連結流動性カバレッジ比率	165.6%	181.0%	150.6%	135.7%	141.7%

連結流動性カバレッジ比率に関する定性的開示事項

1. 時系列における連結流動性カバレッジ比率の変動に関する事項

当最終指定親会社四半期の適格流動資産の合計額は前最終指定親会社四半期比 1,784 億 25 百万円増の 2 兆 7,167 億円 87 百万円となりました。ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額が同 1,179 億 41 百万円増の 1 兆 5,051 億円 12 百万円、貸付金等の回収に係る資金流入額が同 326 億 33 百万円増の 4,881 億円 42 百万円、その他資金流入額が同 1,845 億 47 百万円減の 1 兆 784 億円 43 百万円となり、純資金流出額は同 2,377 億 62 百万円増の 1 兆 6,396 億円 82 百万円となりました。

その結果、連結流動性カバレッジ比率は同 15.4%減の 165.6%となり、過去 2 年間概ね安定的に推移しております。

2. 連結流動性カバレッジ比率の水準の評価に関する事項

当社グループでは、「規制流動性管理規程」を定め、法令上の最低水準を上回る水準を確保するだけでなく、社内の警戒水準を設定して十分な水準が確保されているかを定期的に評価しております。

当社グループの連結流動性カバレッジ比率は、法令上の最低水準を十分に上回っております。

3. 算入可能適格流動資産の合計額の内容に関する事項

内容に関する著しい変動はありません。

4. その他連結流動性カバレッジ比率に関する事項

開示が必要な重要事項はございません。

以 上