

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（平成30年3月期 第3四半期）

1. 連結流動性カバレッジ比率(平成27年金融庁告示第7号 別紙様式第二号)

(単位:百万円、%、件)

| 項目           |   | 当四半期         |              | 前四半期         |              |
|--------------|---|--------------|--------------|--------------|--------------|
| 適格流動資産       |   |              |              |              |              |
| 1            | 適格流動資産の合計額                                      | 1,023,551    |              | 1,015,074    |              |
| 資金流出額        |   | 資金流出率を乗じる前の額 | 資金流出率を乗じた後の額 | 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                             | 3,483,366    | 273,979      | 3,473,878    | 272,891      |
| 3            | うち、安定預金の額                                       | 1,076,352    | 32,290       | 1,077,483    | 32,324       |
| 4            | うち、準安定預金の額                                      | 2,407,014    | 241,689      | 2,396,395    | 240,566      |
| 5            | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                           | 856,285      | 391,833      | 833,615      | 366,328      |
| 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 | 824,733      | 360,280      | 809,828      | 342,541      |
| 8            | うち、負債性有価証券の額                                    | 31,552       | 31,552       | 23,787       | 23,787       |
| 9            | 有担保資金調達等に係る資金流出額                                |              | 0            |              | 0            |
| 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       | 1,584,769    | 151,982      | 1,598,218    | 156,276      |
| 11           | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                            | 24,148       | 24,148       | 25,638       | 25,638       |
| 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                         | 1,560,621    | 127,833      | 1,572,579    | 130,637      |
| 14           | 資金提供義務に基づく資金流出額等                                | 40,878       | 32,574       | 36,032       | 34,226       |
| 15           | 偶発事象に係る資金流出額                                    | 27,336       | 3,688        | 26,209       | 2,663        |
| 16           | 資金流出合計額   |              | 854,057      |              | 832,386      |
| 資金流入額        |   | 資金流入率を乗じる前の額 | 資金流入率を乗じた後の額 | 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                                | -            | -            | -            | -            |
| 18           | 貸付金等の回収に係る資金流入額                                 | 255,664      | 140,391      | 254,137      | 140,024      |
| 19           | その他資金流入額  | 57,612       | 36,961       | 59,099       | 40,112       |
| 20           | 資金流入合計額   | 313,277      | 177,353      | 313,237      | 180,136      |
| 連結流動性カバレッジ比率 |   |              |              |              |              |
| 21           | 算入可能適格流動資産の合計額                                  |              | 1,023,551    |              | 1,015,074    |
| 22           | 純資金流出額  |              | 676,704      |              | 652,250      |
| 23           | 連結流動性カバレッジ比率                                    |              | 151.2        |              | 155.6        |
| 24           | 平均値計算用データ数                                      |              | 62           |              | 62           |

2. 単体流動性カバレッジ比率(平成27年金融庁告示第7号 別紙様式第一号)

(単位:百万円、%、件)

| 項目           |   | 当四半期                 |                      | 前四半期                 |                      |
|--------------|---|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| 適格流動資産       |   |                      |                      |                      |                      |
| 1            | 適格流動資産の合計額  | 1,023,551            |                      | 1,015,074            |                      |
| 資金流出額        |   | 資金流出率<br>を乗じる前<br>の額 | 資金流出率<br>を乗じた後<br>の額 | 資金流出率<br>を乗じる前<br>の額 | 資金流出率<br>を乗じた後<br>の額 |
| 2            | リテール無担保資金調達に係る資金流出額                                 | 3,483,397            | 273,982              | 3,473,966            | 272,900              |
| 3            | うち、安定預金の額   | 1,076,352            | 32,290               | 1,077,485            | 32,324               |
| 4            | うち、準安定預金の額  | 2,407,045            | 241,692              | 2,396,481            | 240,575              |
| 5            | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                               | 860,196              | 395,744              | 837,917              | 370,629              |
| 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<br>以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額 | 827,983              | 363,530              | 813,063              | 345,775              |
| 8            | うち、負債性有価証券の額  | 32,213               | 32,213               | 24,854               | 24,854               |
| 9            | 有担保資金調達等に係る資金流出額                                    |                      | 0                    |                      | 0                    |
| 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<br>性ファシリティに係る資金流出額       | 1,566,797            | 154,069              | 1,576,876            | 157,155              |
| 11           | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                                | 24,148               | 24,148               | 25,638               | 25,638               |
| 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                             | 1,542,648            | 129,921              | 1,551,237            | 131,516              |
| 14           | 資金提供義務に基づく資金流出額等                                    | 17,946               | 9,642                | 13,752               | 11,947               |
| 15           | 偶発事象に係る資金流出額  | 27,317               | 3,668                | 26,192               | 2,646                |
| 16           | 資金流出合計額   |                      | 837,108              |                      | 815,279              |
| 資金流入額        |   | 資金流入率<br>を乗じる前<br>の額 | 資金流入率<br>を乗じた後<br>の額 | 資金流入率<br>を乗じる前<br>の額 | 資金流入率<br>を乗じた後<br>の額 |
| 17           | 有担保資金運用等に係る資金流入額                                    | -                    | -                    | -                    | -                    |
| 18           | 貸付金等の回収に係る資金流入額                                     | 262,336              | 147,063              | 261,186              | 147,073              |
| 19           | その他資金流入額  | 57,612               | 36,961               | 59,105               | 40,117               |
| 20           | 資金流入合計額   | 319,949              | 184,025              | 320,291              | 187,190              |
| 単体流動性カバレッジ比率 |   |                      |                      |                      |                      |
| 21           | 算入可能適格流動資産の合計額                                      |                      | 1,023,551            |                      | 1,015,074            |
| 22           | 純資金流出額  |                      | 653,082              |                      | 628,088              |
| 23           | 単体流動性カバレッジ比率  |                      | 156.7                |                      | 161.6                |
| 24           | 平均値計算用データ数  |                      | 62                   |                      | 62                   |