

単体流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項(2019年3月期 第3四半期)

(単位：百万円、%、件)

| 項目                      |                                                 | 当四半期         |              | 前四半期         |              |
|-------------------------|-------------------------------------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| <b>適格流動資産 (1)</b>       |                                                 |              |              |              |              |
| 1                       | 適格流動資産の合計額                                      | 1,999,929    |              | 1,988,838    |              |
| <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                             | 2,622,764    | 252,985      | 2,602,687    | 250,746      |
| 3                       | うち、安定預金の額                                       | 149,503      | 4,485        | 152,971      | 4,589        |
| 4                       | うち、準安定預金の額                                      | 2,473,261    | 248,500      | 2,449,716    | 246,157      |
| 5                       | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                           | 2,553,547    | 1,011,766    | 2,475,291    | 999,419      |
| 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 | 2,416,113    | 874,331      | 2,337,112    | 861,240      |
| 8                       | うち、負債性有価証券の額                                    | 137,434      | 137,434      | 138,179      | 138,179      |
| 9                       | 有担保資金調達等に係る資金流出額                                |              | -            |              | -            |
| 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       | 449,621      | 76,883       | 449,871      | 80,060       |
| 11                      | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                            | 52,939       | 52,939       | 56,280       | 56,280       |
| 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                         | 396,682      | 23,944       | 393,591      | 23,779       |
| 14                      | 資金提供義務に基づく資金流出額等                                | 114,195      | 19,958       | 108,077      | 17,479       |
| 15                      | 偶発事象に係る資金流出額                                    | 1,369,033    | 55,652       | 1,363,733    | 55,518       |
| 16                      | 資金流出合計額                                         |              | 1,417,245    |              | 1,403,224    |
| <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                                | -            | -            | -            | -            |
| 18                      | 貸付金等の回収に係る資金流入額                                 | 694,683      | 417,477      | 618,140      | 342,232      |
| 19                      | その他資金流入額                                        | 70,313       | 30,553       | 72,463       | 32,949       |
| 20                      | 資金流入合計額                                         | 764,996      | 448,031      | 690,603      | 375,181      |
| <b>単体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                                  |              | 1,999,929    |              | 1,988,838    |
| 22                      | 純資金流出額                                          |              | 969,213      |              | 1,028,042    |
| 23                      | 単体流動性カバレッジ比率                                    |              | 206.3        |              | 193.4        |
| 24                      | 平均値計算用データ数                                      | 62           |              | 62           |              |