

## 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2四半期)

(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                                      | 1,988,838    |              | 1,962,484    |              |
| <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                             | 2,602,687    | 250,746      | 2,537,595    | 244,425      |
| 3                       | うち、安定預金の額                                       | 152,971      | 4,589        | 150,801      | 4,524        |
| 4                       | うち、準安定預金の額                                      | 2,449,716    | 246,157      | 2,386,794    | 239,901      |
| 5                       | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                           | 2,475,291    | 999,419      | 2,461,731    | 992,975      |
| 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 | 2,337,112    | 861,240      | 2,294,209    | 825,453      |
| 8                       | うち、負債性有価証券の額                                    | 138,179      | 138,179      | 167,521      | 167,521      |
| 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       | 449,871      | 80,060       | 455,633      | 83,979       |
| 11                      | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                            | 56,280       | 56,280       | 59,980       | 59,980       |
| 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                         | 393,591      | 23,779       | 395,652      | 23,998       |
| 14                      | 資金提供義務に基づく資金流出額等                                | 108,077      | 17,479       | 111,458      | 22,550       |
| 15                      | 偶発事象に係る資金流出額                                    | 1,363,733    | 55,518       | 1,362,851    | 55,465       |
| 16                      | 資金流出合計額                                         |              | 1,403,224    |              | 1,399,395    |
| <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                                 | 618,140      | 342,232      | 648,745      | 376,196      |
| 19                      | その他資金流入額                                        | 72,463       | 32,949       | 80,961       | 36,754       |
| 20                      | 資金流入合計額                                         | 690,603      | 375,181      | 729,707      | 412,950      |
| <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                                  |              | 1,988,838    |              | 1,962,484    |
| 22                      | 純資金流出額                                          |              | 1,028,042    |              | 986,444      |
| 23                      | 単体流動性カバレッジ比率                                    |              | 193.4        |              | 198.9        |
| 24                      | 平均値計算用データ数                                      | 62           |              | 62           |              |