

単体流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（29年3月期）

（27年2月27日金融庁告示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                 |                      |
|------------------------|---|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| <b>適格流動資産（1）</b>       |   |                      |                      |                      |                      |
| 1                      | 適格流動資産の合計額  | 1,528,105            |                      | 1,572,878            |                      |
| <b>資金流出額（2）</b>        |   | 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                                 | 4,758,991            | 368,957              | 4,708,804            | 365,987              |
| 3                      | うち、安定預金の額   | 1,601,406            | 48,042               | 1,571,553            | 47,146               |
| 4                      | うち、準安定預金の額  | 3,156,828            | 320,915              | 3,136,687            | 318,840              |
| 5                      | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                               | 1,388,035            | 651,528              | 1,255,105            | 543,392              |
| 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 | 1,185,383            | 448,876              | 1,102,382            | 390,670              |
| 8                      | うち、負債性有価証券の額  | 202,652              | 202,652              | 152,722              | 152,722              |
| 9                      | 有担保資金調達等に係る資金流出額                                    |                      | 6,557                |                      | 19,391               |
| 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       | 2,068,782            | 379,177              | 2,098,126            | 385,279              |
| 11                     | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                                | 151,443              | 151,443              | 155,602              | 155,602              |
| 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                             | 1,917,338            | 227,733              | 1,942,523            | 229,676              |
| 14                     | 資金提供義務に基づく資金流出額等                                    | 36,561               | 26,173               | 25,063               | 19,614               |
| 15                     | 偶発事象に係る資金流出額  | 33,745               | 674                  | 30,288               | 605                  |
| 16                     | 資金流出合計額   |                      | 1,433,069            |                      | 1,334,271            |
| <b>資金流入額（3）</b>        |   | 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                                     | 653,903              | 439,983              | 510,041              | 349,332              |
| 19                     | その他資金流入額  | 246,263              | 195,767              | 236,993              | 198,586              |
| 20                     | 資金流入合計額   | 900,166              | 635,750              | 747,035              | 547,919              |
| <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                                      |                      | 1,528,105            |                      | 1,572,878            |
| 22                     | 純資金流出額  |                      | 797,318              |                      | 786,352              |
| 23                     | 単体流動性カバレッジ比率  |                      | 191.6%               |                      | 200.0%               |
| 24                     | 平均値計算用データ数  |                      | 61                   |                      | 3                    |

連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（29年3月期）

（27年2月27日金融庁告示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                 |                      |
|------------------------|---|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| <b>適格流動資産（1）</b>       |   |                      |                      |                      |                      |
| 1                      | 適格流動資産の合計額  | 1,528,105            |                      | 1,572,878            |                      |
| <b>資金流出額（2）</b>        |   | 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                                 | 4,758,988            | 368,956              | 4,708,799            | 365,987              |
| 3                      | うち、安定預金の額   | 1,601,406            | 48,042               | 1,571,553            | 47,146               |
| 4                      | うち、準安定預金の額  | 3,156,824            | 320,914              | 3,136,682            | 318,840              |
| 5                      | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                               | 1,379,142            | 642,635              | 1,246,051            | 534,339              |
| 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 | 1,177,570            | 441,063              | 1,094,095            | 382,383              |
| 8                      | うち、負債性有価証券の額  | 201,571              | 201,571              | 151,955              | 151,955              |
| 9                      | 有担保資金調達等に係る資金流出額                                    |                      | 6,557                |                      | 19,391               |
| 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       | 2,039,267            | 367,371              | 2,070,044            | 374,046              |
| 11                     | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                                | 151,443              | 151,443              | 155,602              | 155,602              |
| 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                             | 1,887,824            | 215,927              | 1,914,441            | 218,443              |
| 14                     | 資金提供義務に基づく資金流出額等                                    | 64,540               | 54,151               | 51,990               | 46,541               |
| 15                     | 偶発事象に係る資金流出額  | 33,745               | 674                  | 30,288               | 605                  |
| 16                     | 資金流出合計額   |                      | 1,440,347            |                      | 1,340,911            |
| <b>資金流入額（3）</b>        |   | 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                                     | 621,870              | 408,192              | 477,583              | 317,124              |
| 19                     | その他資金流入額  | 246,248              | 195,752              | 236,978              | 198,571              |
| 20                     | 資金流入合計額   | 868,118              | 603,944              | 714,562              | 515,696              |
| <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                                      |                      | 1,528,105            |                      | 1,572,878            |
| 22                     | 純資金流出額  |                      | 836,403              |                      | 825,215              |
| 23                     | 連結流動性カバレッジ比率  |                      | 182.6%               |                      | 190.6%               |
| 24                     | 平均値計算用データ数  |                      | 61                   |                      | 3                    |