

## 〈流動性カバレッジ比率に関する開示事項〉(平成30年3月期 中間決算)

## 1. 連結流動性カバレッジ比率

(単位:百万円、%、件)

項目		当四半期		前四半期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	800,844		767,240	
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	2,488,999	195,326	2,463,600	193,782
3	うち、安定預金の額	775,049	23,251	760,296	22,808
4	うち、準安定預金の額	1,713,950	172,075	1,703,303	170,973
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	971,276	573,609	925,186	522,303
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	883,953	486,286	856,589	453,707
8	うち、負債性有価証券の額	87,323	87,323	68,596	68,596
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		427		1,663
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	43,335	31,388	66,873	51,906
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	29,682	29,682	50,147	50,147
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	13,652	1,705	16,726	1,759
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	41,662	31,162	53,952	31,432
15	偶発事象に係る資金流出額	573,843	16,996	528,094	15,627
16	資金流出合計額		848,911		816,716
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	-	-	-	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	372,803	302,379	213,200	192,110
19	その他資金流入額	71,865	56,034	146,933	97,070
20	資金流入合計額	444,669	358,414	360,133	289,181
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		800,844		767,240
22	純資金流出額		490,497		527,534
23	連結流動性カバレッジ比率		163.2		145.4
24	平均値計算用データ数	62		62	

上記は、平成27年金融庁告示第7号の別紙様式第2号に基づく開示事項です。

## 2. 単体流動性カバレッジ比率

(単位:百万円、%、件)

項 目		当四半期		前四半期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	800,844		767,240	
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	2,488,999	195,326	2,463,600	193,782
3	うち、安定預金の額	775,049	23,251	760,296	22,808
4	うち、準安定預金の額	1,713,950	172,075	1,703,303	170,973
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	974,302	576,635	928,260	525,378
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	886,978	489,311	859,663	456,781
8	うち、負債性有価証券の額	87,323	87,323	68,596	68,596
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		427		1,663
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	43,335	31,388	64,350	51,906
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	29,682	29,682	50,147	50,147
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	13,652	1,705	14,203	1,759
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	41,662	29,540	53,952	30,414
15	偶発事象に係る資金流出額	552,423	16,376	506,509	15,003
16	資金流出合計額		849,694		818,148
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	-	-	-	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	370,111	301,258	209,836	190,321
19	その他資金流入額	71,872	55,757	146,939	95,613
20	資金流入合計額	441,984	357,016	356,775	285,935
単体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		800,844		767,240
22	純資金流出額		492,677		532,213
23	単体流動性カバレッジ比率		162.5		144.1
24	平均値計算用データ数	62		62	

上記は、平成27年金融庁告示第7号の別紙様式第1号に基づく開示事項です。

**連結流動性カバレッジ比率**

中間期は訂正ございません。前四半期分を訂正しております。

(単位:百万円、%、件)

項目		前四半期 訂正後		前四半期 訂正前 (29/8/31公表)	
		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
資金流出額 (2)					
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	2,463,600	193,782	2,213,492	193,766
3	うち、安定預金の額	760,296	22,808	655,687	22,808
4	うち、準安定預金の額	1,703,303	170,973	1,557,806	170,957
16	資金流出合計額		816,716		816,700
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		767,240		767,240
22	純資金流出額		527,534		527,519
23	連結流動性カバレッジ比率		145.4		145.4
24	平均値計算用データ数	62		62	

下線箇所を訂正しております。