

## 〈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 第3四半期決算)

## 1. 連結流動性カバレッジ比率

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	762,077		800,844	
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	2,504,623	196,340	2,488,999	195,326
3	うち、安定預金の額	782,802	23,484	775,049	23,251
4	うち、準安定預金の額	1,721,821	172,854	1,713,950	172,075
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,122,137	716,259	971,276	573,609
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	1,053,388	647,510	883,953	486,286
8	うち、負債性有価証券の額	68,748	68,748	87,323	87,323
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		1,412		427
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	39,895	28,077	43,335	31,388
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	26,349	26,349	29,682	29,682
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	13,546	1,728	13,652	1,705
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	61,771	49,317	41,662	31,162
15	偶発事象に係る資金流出額	576,847	17,091	573,843	16,996
16	資金流出合計額		1,009,617		848,911
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	443,415	382,263	372,803	302,379
19	その他資金流入額	75,239	70,227	71,865	56,034
20	資金流入合計額	518,655	452,491		358,414
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		762,077		800,844
22	純資金流出額		557,126		490,497
23	連結流動性カバレッジ比率		136.7		163.20
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	762,077		800,844	
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	2,504,623	196,340	2,488,999	195,326
3	うち、安定預金の額	782,802	23,484	775,049	23,251
4	うち、準安定預金の額	1,721,821	172,854	1,713,950	172,075
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,124,933	719,055	974,302	576,635
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	1,056,184	650,306	886,978	489,311
8	うち、負債性有価証券の額	68,748	68,748	87,323	87,323
9	有担保資金調達等に係る資金流出額			427	
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	39,895	28,077	43,335	31,388
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	26,349	26,349	29,682	29,682
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	13,546	1,728	13,652	1,705
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	61,771	47,739	41,662	29,540
15	偶発事象に係る資金流出額	556,494	16,496	552,423	16,376
16	資金流出合計額	1,010,240		849,694	
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	440,937	381,377	370,111	301,258
19	その他資金流入額	75,246	70,105	71,872	55,757
20	資金流入合計額	516,184	451,482	357,016	
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	762,077		800,844	
22	純資金流出額	558,757		492,677	
23	単体流動性カバレッジ比率	136.3		162.50	
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。

## 訂正 平成29年12月31日分 新旧対照表

### 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 訂正後		修正前(30/2/28公表)	
		資金流出率を乗じる前の額 (変更なし)	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	2,504,623	<u>196,340</u>	2,504,623	196,357
3	うち、安定預金の額	782,802	23,484	782,802	23,484
4	うち、準安定預金の額	1,721,821	<u>172,854</u>	1,721,821	172,871
16	資金流出合計額		<u>1,010,240</u>		1,010,257
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		762,077		762,077
22	純資金流出額		<u>558,757</u>		558,774
23	単体流動性カバレッジ比率 (変更なし)		136.3		136.3

下線部分を訂正しております。