

# [流動性に係る経営の健全性の状況について<流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項>]

## (流動性カバレッジ比率に関する定量的事項【連結】)

(単位：百万円、%、件)

項目		2018年3月期 第4四半期		2018年3月期 第3四半期	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	1,364,645		1,348,966	
<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	3,638,375	291,867	3,630,645	292,202
3	うち、安定預金の額	1,035,033	31,051	1,019,773	30,593
4	うち、準安定預金の額	2,602,731	260,816	2,610,564	261,609
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,677,788	1,036,471	1,521,834	896,373
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	1,425,645	784,329	1,290,603	665,143
8	うち、負債性有価証券の額	252,142	252,142	231,230	231,230
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	1,393,386	315,421	1,316,417	256,687
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	207,256	207,256	151,822	151,822
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	1,186,129	108,165	1,164,594	104,864
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	11,669	9,429	7,533	4,973
15	偶発事象に係る資金流出額	36,420	4,396	32,857	1,615
16	資金流出合計額	—	1,657,586	—	1,451,852
<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	24	24	—	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	414,584	248,420	371,302	214,527
19	その他資金流入額	241,083	216,482	177,635	156,457
20	資金流入合計額	655,692	464,927	548,938	370,984
<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	—	1,364,645	—	1,348,966
22	純資金流出額	—	1,192,658	—	1,080,867
23	連結流動性カバレッジ比率	—	114.4%	—	124.8%
24	平均値計算用データ数	59件		62件	

## (流動性カバレッジ比率に関する定量的事項【単体】)

(単位：百万円、%、件)

項目		2018年3月期 第4四半期		2018年3月期 第3四半期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,364,645		1,348,966	
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	3,638,375	291,867	3,630,645	292,202
3	うち、安定預金の額	1,035,033	31,051	1,019,773	30,593
4	うち、準安定預金の額	2,602,731	260,816	2,610,564	261,609
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,665,245	1,023,929	1,510,837	885,377
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	1,412,066	770,749	1,279,008	653,548
8	うち、負債性有価証券の額	253,179	253,179	231,829	231,829
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	1,393,386	315,421	1,316,417	256,687
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	207,256	207,256	151,822	151,822
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	1,186,129	108,165	1,164,594	104,864
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	11,669	9,429	7,533	4,973
15	偶発事象に係る資金流出額	36,420	4,396	32,857	1,615
16	資金流出合計額	1,645,044		1,440,855	
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	24	24	—	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	426,292	260,123	382,672	225,897
19	その他資金流入額	241,088	216,487	177,640	156,461
20	資金流入合計額	667,405	476,635	560,313	382,358
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	1,364,645		1,348,966	
22	純資金流出額	1,168,408		1,058,496	
23	単体流動性カバレッジ比率	116.7%		127.4%	
24	平均値計算用データ数	59件		62件	