

# 〔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		2019年3月期 第2四半期		2019年3月期 第1四半期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,407,791		1,454,618	
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	3,667,513	293,472	3,643,919	292,619
3	うち、安定預金の額	1,053,819	31,614	1,032,585	30,977
4	うち、準安定預金の額	2,613,535	261,857	2,610,919	261,642
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,686,116	1,050,025	1,690,693	1,033,244
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	1,437,992	801,901	1,439,387	781,939
8	うち、負債性有価証券の額	248,124	248,124	251,305	251,305
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	1,412,765	312,169	1,413,717	315,560
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	200,019	200,019	204,657	204,657
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	1,212,746	112,150	1,209,059	110,902
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	3,363	2,277	4,389	3,022
15	偶発事象に係る資金流出額	39,732	9,171	36,549	7,514
16	資金流出合計額	1,667,117		1,651,961	
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	6,912	—	168	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	353,840	192,184	331,666	182,539
19	その他資金流入額	217,300	204,933	241,136	221,274
20	資金流入合計額	578,053	397,117	572,971	403,813
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	1,407,791		1,454,618	
22	純資金流出額	1,269,999		1,248,147	
23	連結流動性カバレッジ比率	110.8%		116.5%	
24	平均値計算用データ数	62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		2019年3月期 第2四半期		2019年3月期 第1四半期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,407,791		1,454,618	
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	3,667,513	293,472	3,643,919	292,619
3	うち、安定預金の額	1,053,819	31,614	1,032,585	30,977
4	うち、準安定預金の額	2,613,535	261,857	2,610,919	261,642
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,676,795	1,040,704	1,681,886	1,024,438
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	1,427,606	791,515	1,429,956	772,508
8	うち、負債性有価証券の額	249,188	249,188	251,929	251,929
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	1,412,765	312,169	1,413,717	315,560
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	200,019	200,019	204,657	204,657
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	1,212,746	112,150	1,209,059	110,902
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	3,363	2,277	4,389	3,022
15	偶発事象に係る資金流出額	39,732	9,171	36,549	7,514
16	資金流出合計額		1,657,796		1,643,155
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	6,912	—	168	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	365,003	203,342	342,854	193,726
19	その他資金流入額	217,305	204,937	241,140	221,278
20	資金流入合計額	589,221	408,280	584,163	415,005
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		1,407,791		1,454,618
22	純資金流出額		1,249,516		1,228,149
23	単体流動性カバレッジ比率		112.6%		118.4%
24	平均値計算用データ数	62件		62件	