

連結流動性カバレッジ比率

(単位：百万円、%、件)

| 項目                                                      | 当四半期<br>(2019年度第4四半期) |                  | 前四半期<br>(2019年度第3四半期) |                  |
|---------------------------------------------------------|-----------------------|------------------|-----------------------|------------------|
| 適格流動資産                                                  |                       |                  |                       |                  |
| 適格流動資産の合計額                                              | 1, 542, 949           |                  | 1, 341, 207           |                  |
| 資金流出額                                                   | 資金流出率を<br>乗じる前の額      | 資金流出率を<br>乗じた後の額 | 資金流出率を<br>乗じる前の額      | 資金流出率を<br>乗じた後の額 |
| リテール無担保資金調達に係る資金流出額                                     | 7, 131, 147           | 525, 786         | 7, 128, 241           | 528, 266         |
| うち、安定預金の額                                               | 2, 681, 577           | 80, 447          | 2, 642, 124           | 79, 263          |
| うち、準安定預金の額                                              | 4, 449, 477           | 445, 339         | 4, 486, 045           | 449, 002         |
| ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                                   | 2, 760, 450           | 1, 471, 689      | 2, 488, 288           | 1, 246, 416      |
| うち、適格オペレーショナル預金の額                                       | －                     | －                | －                     | －                |
| うち、適格オペレーショナル預金及び負債性<br>有価証券以外のホールセール無担保資金調達<br>に係る資金の額 | 2, 670, 994           | 1, 382, 233      | 2, 360, 021           | 1, 118, 148      |
| うち、負債性有価証券の額                                            | 89, 456               | 89, 456          | 128, 267              | 128, 267         |
| 有担保資金調達等に係る資金流出額                                        |                       | －                |                       | －                |
| デリバティブ取引等、資金調達プログラム及び<br>与信・流動性ファシリティに係る資金流出額           | 493, 078              | 303, 194         | 474, 007              | 279, 531         |
| うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                                    | 274, 854              | 274, 854         | 249, 352              | 249, 352         |
| うち、資金調達プログラムに係る資金流出額                                    | －                     | －                | －                     | －                |
| うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額                                 | 218, 223              | 28, 339          | 224, 655              | 30, 178          |
| 資金提供義務に基づく資金流出額等                                        | 98, 990               | 68, 668          | 98, 045               | 78, 357          |
| 偶発事象に係る資金流出額                                            | 3, 346, 540           | 39, 235          | 3, 403, 993           | 40, 115          |
| 資金流出合計額                                                 |                       | 2, 408, 574      |                       | 2, 172, 686      |
| 資金流入額                                                   | 資金流入率を<br>乗じる前の額      | 資金流入率を<br>乗じた後の額 | 資金流入率を<br>乗じる前の額      | 資金流入率を<br>乗じた後の額 |
| 有担保資金運用等に係る資金流入額                                        | 24                    | 24               | －                     | －                |
| 貸付金等の回収に係る資金流入額                                         | 1, 254, 183           | 850, 322         | 1, 296, 649           | 897, 230         |
| その他資金流入額                                                | 465, 382              | 446, 431         | 420, 899              | 395, 111         |
| 資金流入合計額                                                 | 1, 719, 591           | 1, 296, 778      | 1, 717, 548           | 1, 292, 341      |
| 連結流動性カバレッジ比率                                            |                       |                  |                       |                  |
| 算入可能適格流動資産の合計額                                          |                       | 1, 542, 949      |                       | 1, 341, 207      |
| 純資金流出額                                                  |                       | 1, 111, 796      |                       | 880, 345         |
| 連結流動性カバレッジ比率                                            |                       | 138. 7           |                       | 152. 3           |
| 平均値計算用データ数                                              | 58                    |                  | 62                    |                  |