

## 〈流動性カバレッジ比率に関する開示事項〉(2022年3月期 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                                      | 1,146,733    |              | 1,164,987    |              |
| 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                             | 3,014,600    | 225,274      | 2,983,218    | 224,082      |
| 3                | うち、安定預金の額                                       | 1,097,233    | 32,920       | 1,069,616    | 32,091       |
| 4                | うち、準安定預金の額                                      | 1,917,366    | 192,317      | 1,913,601    | 191,953      |
| 5                | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                           | 1,694,028    | 1,060,327    | 1,719,353    | 1,083,492    |
| 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 | 1,691,917    | 1,058,216    | 1,712,992    | 1,077,130    |
| 8                | うち、負債性有価証券の額                                    | 2,111        | 2,111        | 6,361        | 6,361        |
| 9                | 有担保資金調達等に係る資金流出額                                |              | 16,943       |              | 15,962       |
| 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       | 54,167       | 42,072       | 38,533       | 24,598       |
| 11               | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                            | 40,228       | 40,228       | 22,772       | 22,772       |
| 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                         | 13,938       | 1,843        | 15,761       | 1,826        |
| 14               | 資金提供義務に基づく資金流出額等                                | 151,588      | 137,842      | 106,938      | 88,397       |
| 15               | 偶発事象に係る資金流出額                                    | 560,260      | 16,590       | 561,333      | 16,624       |
| 16               | 資金流出合計額   |              | 1,499,051    |              | 1,453,158    |
| 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                                | 105,152      | 105,152      | 93,650       | 93,650       |
| 18               | 貸付金等の回収に係る資金流入額                                 | 907,766      | 821,450      | 875,280      | 796,708      |
| 19               | その他資金流入額  | 105,564      | 93,744       | 105,616      | 92,926       |
| 20               | 資金流入合計額   | 1,118,484    | 1,020,348    | 1,074,547    | 983,285      |
| 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                                  |              | 1,146,733    |              | 1,164,987    |
| 22               | 純資金流出額  |              | 498,394      |              | 497,909      |
| 23               | 連結流動性カバレッジ比率                                    |              | 230.0        |              | 233.9        |
| 24               | 平均値計算用データ数                                      | 59           |              | 63           |              |

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                                      | 1,146,733    |              | 1,164,987    |              |
| 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                             | 3,014,600    | 225,274      | 2,983,218    | 224,082      |
| 3                | うち、安定預金の額                                       | 1,097,233    | 32,920       | 1,069,616    | 32,091       |
| 4                | うち、準安定預金の額                                      | 1,917,366    | 192,317      | 1,913,601    | 191,953      |
| 5                | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                           | 1,695,888    | 1,062,186    | 1,721,894    | 1,086,032    |
| 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 | 1,693,777    | 1,060,075    | 1,715,532    | 1,079,670    |
| 8                | うち、負債性有価証券の額                                    | 2,111        | 2,111        | 6,361        | 6,361        |
| 9                | 有担保資金調達等に係る資金流出額                                |              | 16,943       |              | 15,962       |
| 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       | 54,167       | 42,072       | 38,533       | 24,598       |
| 11               | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                            | 40,228       | 40,228       | 22,772       | 22,772       |
| 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                         | 13,938       | 1,843        | 15,761       | 1,826        |
| 14               | 資金提供義務に基づく資金流出額等                                | 150,535      | 136,789      | 105,619      | 87,078       |
| 15               | 偶発事象に係る資金流出額                                    | 546,371      | 16,174       | 550,271      | 16,293       |
| 16               | 資金流出合計額   |              | 1,499,441    |              | 1,454,048    |
| 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                                | 105,152      | 105,152      | 93,650       | 93,650       |
| 18               | 貸付金等の回収に係る資金流入額                                 | 912,308      | 827,237      | 878,511      | 800,904      |
| 19               | その他資金流入額  | 105,573      | 93,753       | 105,623      | 92,933       |
| 20               | 資金流入合計額   | 1,123,034    | 1,026,143    | 1,077,785    | 987,488      |
| 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                                  |              | 1,146,733    |              | 1,164,987    |
| 22               | 純資金流出額  |              | 494,606      |              | 495,594      |
| 23               | 単体流動性カバレッジ比率                                    |              | 231.8        |              | 235.0        |
| 24               | 平均値計算用データ数                                      | 59           |              | 63           |              |

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。