

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（2019年3月期 第1四半期）

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	適格流動資産の合計額	1,047,290		1,063,879	
資金流出額		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	3,521,592	276,573	3,509,391	275,072
3	うち、安定預金の額	1,094,692	32,840	1,098,367	32,951
4	うち、準安定預金の額	2,426,899	243,732	2,411,023	242,121
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	932,565	410,551	917,588	434,869
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	902,501	380,488	888,211	405,491
8	うち、負債性有価証券の額	30,063	30,063	29,377	29,377
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		1,285		184
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	1,604,319	162,072	1,595,128	163,271
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	32,762	32,762	35,315	35,315
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	1,571,557	129,310	1,559,812	127,955
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	39,756	34,573	40,125	36,731
15	偶発事象に係る資金流出額	27,500	3,611	28,462	3,982
16	資金流出合計額		888,668		914,111
資金流入額		資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額	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	273,442	149,301	285,762	157,760
19	その他資金流入額	57,005	44,487	75,872	60,659
20	資金流入合計額	330,447	193,788	361,634	218,419
連結流動性カバレッジ比率					
21	算入可能適格流動資産の合計額		1,047,290		1,063,879
22	純資金流出額		694,879		695,692
23	連結流動性カバレッジ比率		150.7		152.9
24	平均値計算用データ数		62		59

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	適格流動資産の合計額	1,047,290		1,063,879	
資金流出額		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	3,521,592	276,573	3,509,482	275,081
3	うち、安定預金の額	1,094,692	32,840	1,098,368	32,951
4	うち、準安定預金の額	2,426,899	243,732	2,411,114	242,130
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	937,892	415,879	922,014	439,295
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	906,471	384,458	891,228	408,509
8	うち、負債性有価証券の額	31,421	31,421	30,785	30,785
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		1,285		184
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	1,585,887	163,657	1,577,515	165,377
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	32,762	32,762	35,315	35,315
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	1,553,125	130,895	1,542,199	130,061
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	16,059	10,876	16,357	12,963
15	偶発事象に係る資金流出額	27,484	3,595	28,443	3,962
16	資金流出合計額		871,867		896,865
資金流入額		資金流入率 を乗じる前 の額	資金流入率 を乗じた後 の額	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	281,020	156,879	292,954	164,951
19	その他資金流入額	57,005	44,487	75,877	60,664
20	資金流入合計額	338,026	201,367	368,831	225,616
単体流動性カバレッジ比率					
21	算入可能適格流動資産の合計額		1,047,290		1,063,879
22	純資金流出額		670,500		671,248
23	単体流動性カバレッジ比率		156.1		158.4
24	平均値計算用データ数		62		59