

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 中間期）

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	1,024,463		1,047,290	
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	3,558,518	278,178	3,521,592	276,573
3	うち、安定預金の額	1,124,474	33,734	1,094,692	32,840
4	うち、準安定預金の額	2,434,043	244,444	2,426,899	243,732
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	942,640	435,180	932,565	410,551
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	918,899	411,439	902,501	380,488
8	うち、負債性有価証券の額	23,740	23,740	30,063	30,063
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		1,806		1,285
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	1,601,497	157,833	1,604,319	162,072
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	28,636	28,636	32,762	32,762
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	1,572,861	129,197	1,571,557	129,310
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	34,629	31,671	39,756	34,573
15	偶発事象に係る資金流出額	30,132	4,795	27,500	3,611
16	資金流出合計額		909,465		888,668
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	302,760	164,469	273,442	149,301
19	その他資金流入額	43,813	34,241	57,005	44,487
20	資金流入合計額	346,573	198,710	330,447	193,788
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		1,024,463		1,047,290
22	純資金流出額		710,754		694,879
23	連結流動性カバレッジ比率		144.1		150.7
24	平均値計算用データ数		62		62

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	1,024,463		1,047,290	
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	3,558,608	278,187	3,521,592	276,573
3	うち、安定預金の額	1,124,476	33,734	1,094,692	32,840
4	うち、準安定預金の額	2,434,132	244,453	2,426,899	243,732
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	948,609	441,149	937,892	415,879
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	923,654	416,194	906,471	384,458
8	うち、負債性有価証券の額	24,955	24,955	31,421	31,421
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		1,806		1,285
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	1,584,174	159,673	1,585,887	163,657
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	28,636	28,636	32,762	32,762
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	1,555,537	131,037	1,553,125	130,895
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	11,734	8,775	16,059	10,876
15	偶発事象に係る資金流出額	30,118	4,781	27,484	3,595
16	資金流出合計額		894,373		871,867
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	310,715	172,423	281,020	156,879
19	その他資金流入額	43,817	34,245	57,005	44,487
20	資金流入合計額	354,532	206,669	338,026	201,367
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		1,024,463		1,047,290
22	純資金流出額		687,703		670,500
23	単体流動性カバレッジ比率		148.9		156.1
24	平均値計算用データ数		62		62