

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3四半期）

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	1,012,230		1,024,463	
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	3,562,592	278,757	3,558,518	278,178
3	うち、安定預金の額	1,121,158	33,634	1,124,474	33,734
4	うち、準安定預金の額	2,441,434	245,122	2,434,043	244,444
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	959,233	453,155	942,640	435,180
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	926,807	420,729	918,899	411,439
8	うち、負債性有価証券の額	32,426	32,426	23,740	23,740
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		1,681		1,806
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	1,594,637	162,799	1,601,497	157,833
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	34,197	34,197	28,636	28,636
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	1,560,440	128,602	1,572,861	129,197
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	36,025	31,407	34,629	31,671
15	偶発事象に係る資金流出額	29,350	5,316	30,132	4,795
16	資金流出合計額		933,118		909,465
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	304,632	164,887	302,760	164,469
19	その他資金流入額	58,942	45,113	43,813	34,241
20	資金流入合計額	363,575	210,000	346,573	198,710
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		1,012,230		1,024,463
22	純資金流出額		723,117		710,754
23	連結流動性カバレッジ比率		139.9		144.1
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	1,012,230		1,024,463	
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	3,562,592	278,757	3,558,608	278,187
3	うち、安定預金の額	1,121,158	33,634	1,124,476	33,734
4	うち、準安定預金の額	2,441,434	245,122	2,434,132	244,453
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	965,451	459,373	948,609	441,149
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	932,373	426,295	923,654	416,194
8	うち、負債性有価証券の額	33,077	33,077	24,955	24,955
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		1,681		1,806
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	1,577,875	164,726	1,584,174	159,673
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	34,197	34,197	28,636	28,636
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	1,543,678	130,529	1,555,537	131,037
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	14,440	9,822	11,734	8,775
15	偶発事象に係る資金流出額	29,336	5,301	30,118	4,781
16	資金流出合計額		919,664		894,373
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	313,286	173,541	310,715	172,423
19	その他資金流入額	58,942	45,113	43,817	34,245
20	資金流入合計額	372,229	218,655	354,532	206,669
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		1,012,230		1,024,463
22	純資金流出額		701,009		687,703
23	単体流動性カバレッジ比率		144.3		148.9
24	平均値計算用データ数	62		62	