

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）

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	998,088		1,012,230	
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	3,595,761	280,217	3,562,592	278,757
3	うち、安定預金の額	1,149,100	34,473	1,121,158	33,634
4	うち、準安定預金の額	2,446,661	245,744	2,441,434	245,122
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	951,910	439,583	959,233	453,155
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	928,125	415,797	926,807	420,729
8	うち、負債性有価証券の額	23,785	23,785	32,426	32,426
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		933		1,681
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	1,606,090	163,137	1,594,637	162,799
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	34,159	34,159	34,197	34,197
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	1,571,931	128,978	1,560,440	128,602
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	34,618	29,373	36,025	31,407
15	偶発事象に係る資金流出額	31,728	5,916	29,350	5,316
16	資金流出合計額		919,161		933,118
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	323,432	176,996	304,632	164,887
19	その他資金流入額	52,235	40,633	58,942	45,113
20	資金流入合計額	375,667	217,629	363,575	210,000
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		998,088		1,012,230
22	純資金流出額		701,532		723,117
23	連結流動性カバレッジ比率		142.2		139.9
24	平均値計算用データ数		58		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	998,088		1,012,230	
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	3,595,761	280,217	3,562,592	278,757
3	うち、安定預金の額	1,149,100	34,473	1,121,158	33,634
4	うち、準安定預金の額	2,446,661	245,744	2,441,434	245,122
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	958,185	445,858	965,451	459,373
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	932,884	420,556	932,373	426,295
8	うち、負債性有価証券の額	25,301	25,301	33,077	33,077
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		933		1,681
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	1,590,202	165,281	1,577,875	164,726
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	34,159	34,159	34,197	34,197
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	1,556,043	131,121	1,543,678	130,529
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	12,489	7,245	14,440	9,822
15	偶発事象に係る資金流出額	31,714	5,902	29,336	5,301
16	資金流出合計額		905,437		919,664
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	332,086	185,650	313,286	173,541
19	その他資金流入額	52,239	40,637	58,942	45,113
20	資金流入合計額	384,325	226,287	372,229	218,655
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		998,088		1,012,230
22	純資金流出額		679,150		701,009
23	単体流動性カバレッジ比率		146.9		144.3
24	平均値計算用データ数		58		62