

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（平成30年3月期 第1四半期）

1. 連結流動性カバレッジ比率(平成27年金融庁告示第7号 別紙様式第二号)

(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	1,049,530		1,048,006	
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	3,446,391	271,677	3,428,892	269,529
3	うち、安定預金の額	1,054,533	31,636	1,059,392	31,781
4	うち、準安定預金の額	2,391,857	240,041	2,369,499	237,747
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	856,947	365,889	798,473	347,527
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	826,479	335,421	770,939	319,993
8	うち、負債性有価証券の額	30,468	30,468	27,534	27,534
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		0		0
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	1,595,917	153,759	1,608,834	163,185
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	23,714	23,714	31,760	31,760
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	1,572,203	130,045	1,577,074	131,425
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	32,818	29,230	34,521	32,214
15	偶発事象に係る資金流出額	26,419	2,721	28,307	3,156
16	資金流出合計額		823,279		815,614
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	240,746	132,854	260,887	143,816
19	その他資金流入額	60,871	41,259	69,385	48,947
20	資金流入合計額	301,617	174,113	330,273	192,764
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		1,049,530		1,048,006
22	純資金流出額		649,165		622,849
23	連結流動性カバレッジ比率		161.6		168.2
24	平均値計算用データ数		62		61

2. 単体流動性カバレッジ比率(平成27年金融庁告示第7号 別紙様式第一号)

(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	1,049,530		1,048,006	
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	3,446,392	271,677	3,428,982	269,538
3	うち、安定預金の額	1,054,533	31,636	1,059,395	31,781
4	うち、準安定預金の額	2,391,859	240,041	2,369,587	237,756
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	861,553	370,496	802,943	351,998
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	830,420	339,362	774,154	323,208
8	うち、負債性有価証券の額	31,133	31,133	28,789	28,789
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		0		0
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	1,574,483	154,758	1,587,701	164,401
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	23,714	23,714	31,760	31,760
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	1,550,769	131,044	1,555,941	132,641
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	11,177	7,590	11,855	9,548
15	偶発事象に係る資金流出額	26,410	2,712	28,297	3,147
16	資金流出合計額		807,235		798,634
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	247,249	139,357	265,137	148,067
19	その他資金流入額	60,871	41,259	69,391	48,953
20	資金流入合計額	308,120	180,617	334,529	197,021
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		1,049,530		1,048,006
22	純資金流出額		626,618		601,613
23	単体流動性カバレッジ比率		167.4		174.1
24	平均値計算用データ数		62		61