

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 中間期）

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	1,015,074		1,049,530	
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	3,473,878	272,891	3,446,391	271,677
3	うち、安定預金の額	1,077,483	32,324	1,054,533	31,636
4	うち、準安定預金の額	2,396,395	240,566	2,391,857	240,041
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	833,615	366,328	856,947	365,889
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	809,828	342,541	826,479	335,421
8	うち、負債性有価証券の額	23,787	23,787	30,468	30,468
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	1,598,218	156,276	1,595,917	153,759
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	25,638	25,638	23,714	23,714
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	1,572,579	130,637	1,572,203	130,045
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	36,032	34,226	32,818	29,230
15	偶発事象に係る資金流出額	26,209	2,663	26,419	2,721
16	資金流出合計額		832,386		823,279
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	254,137	140,024	240,746	132,854
19	その他資金流入額	59,099	40,112	60,871	41,259
20	資金流入合計額	313,237	180,136	301,617	174,113
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		1,015,074		1,049,530
22	純資金流出額		652,250		649,165
23	連結流動性カバレッジ比率		155.6		161.6
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(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	1,015,074		1,049,530	
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	3,473,966	272,900	3,446,392	271,677
3	うち、安定預金の額	1,077,485	32,324	1,054,533	31,636
4	うち、準安定預金の額	2,396,481	240,575	2,391,859	240,041
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	837,917	370,629	861,553	370,496
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	813,063	345,775	830,420	339,362
8	うち、負債性有価証券の額	24,854	24,854	31,133	31,133
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	1,576,876	157,155	1,574,483	154,758
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	25,638	25,638	23,714	23,714
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	1,551,237	131,516	1,550,769	131,044
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	13,752	11,947	11,177	7,590
15	偶発事象に係る資金流出額	26,192	2,646	26,410	2,712
16	資金流出合計額		815,279		807,235
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	261,186	147,073	247,249	139,357
19	その他資金流入額	59,105	40,117	60,871	41,259
20	資金流入合計額	320,291	187,190	308,120	180,617
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		1,015,074		1,049,530
22	純資金流出額		628,088		626,618
23	単体流動性カバレッジ比率		161.6		167.4
24	平均値計算用データ数		62		62