

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）

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	1,063,879		1,023,551	
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	3,509,391	275,072	3,483,366	273,979
3	うち、安定預金の額	1,098,367	32,951	1,076,352	32,290
4	うち、準安定預金の額	2,411,023	242,121	2,407,014	241,689
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	917,588	434,869	856,285	391,833
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	888,211	405,491	824,733	360,280
8	うち、負債性有価証券の額	29,377	29,377	31,552	31,552
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		184		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	1,595,128	163,271	1,584,769	151,982
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	35,315	35,315	24,148	24,148
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	1,559,812	127,955	1,560,621	127,833
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	40,125	36,731	40,878	32,574
15	偶発事象に係る資金流出額	28,462	3,982	27,336	3,688
16	資金流出合計額		914,111		854,057
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	285,762	157,760	255,664	140,391
19	その他資金流入額	75,872	60,659	57,612	36,961
20	資金流入合計額	361,634	218,419	313,277	177,353
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		1,063,879		1,023,551
22	純資金流出額		695,692		676,704
23	連結流動性カバレッジ比率		152.9		151.2
24	平均値計算用データ数		59		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	1,063,879		1,023,551	
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	3,509,482	275,081	3,483,397	273,982
3	うち、安定預金の額	1,098,368	32,951	1,076,352	32,290
4	うち、準安定預金の額	2,411,114	242,130	2,407,045	241,692
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	922,014	439,295	860,196	395,744
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	891,228	408,509	827,983	363,530
8	うち、負債性有価証券の額	30,785	30,785	32,213	32,213
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		184		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	1,577,515	165,377	1,566,797	154,069
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	35,315	35,315	24,148	24,148
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	1,542,199	130,061	1,542,648	129,921
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	16,357	12,963	17,946	9,642
15	偶発事象に係る資金流出額	28,443	3,962	27,317	3,668
16	資金流出合計額		896,865		837,108
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	292,954	164,951	262,336	147,063
19	その他資金流入額	75,877	60,664	57,612	36,961
20	資金流入合計額	368,831	225,616	319,949	184,025
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		1,063,879		1,023,551
22	純資金流出額		671,248		653,082
23	単体流動性カバレッジ比率		158.4		156.7
24	平均値計算用データ数		59		62