

〈流動性カバレッジ比率に関する開示事項〉(2019年3月期 決算)

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)					
1	適格流動資産の合計額	836,785		846,753	
資金流出額 (2)		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	2,599,823	201,056	2,574,673	199,935
3	うち、安定預金の額	851,036	25,531	831,360	24,940
4	うち、準安定預金の額	1,748,786	175,512	1,743,313	174,987
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,506,406	1,066,133	1,511,550	1,072,165
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	1,458,506	1,018,234	1,453,888	1,014,504
8	うち、負債性有価証券の額	47,899	47,899	57,661	57,661
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		3,477		1,201
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	59,011	46,799	52,376	40,594
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	45,106	45,106	38,926	38,926
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	13,904	1,692	13,449	1,668
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	39,273	36,751	42,071	32,263
15	偶発事象に係る資金流出額	582,913	17,299	589,783	17,507
16	資金流出合計額		1,371,517		1,363,669
資金流入額 (3)		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	711,197	642,342	725,515	642,089
19	その他資金流入額	106,834	110,100	101,425	88,016
20	資金流入合計額	818,032	752,443	826,941	730,105
連結流動性カバレッジ比率 (4)					
21	算入可能適格流動資産の合計額		836,785		846,753
22	純資金流出額		619,073		633,563
23	連結流動性カバレッジ比率		135.1		133.6
24	平均値計算用データ数	58		62	

上記は、平成27年金融庁告示第7号の別紙様式第2号に基づく開示事項です。

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)					
1	適格流動資産の合計額	836,785		846,753	
資金流出額 (2)		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	2,599,823	201,056	2,574,673	199,935
3	うち、安定預金の額	851,036	25,531	831,360	24,940
4	うち、準安定預金の額	1,748,786	175,512	1,743,313	174,987
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,508,995	1,068,722	1,513,982	1,074,598
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	1,461,095	1,020,823	1,456,321	1,016,936
8	うち、負債性有価証券の額	47,899	47,899	57,661	57,661
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		3,477		1,201
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	59,011	46,799	52,376	40,594
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	45,106	45,106	38,926	38,926
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	13,904	1,692	13,449	1,668
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	39,273	35,070	42,071	30,487
15	偶発事象に係る資金流出額	566,764	16,804	573,448	17,006
16	資金流出合計額		1,371,929		1,363,824
資金流入額 (3)		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	710,040	642,720	724,122	642,275
19	その他資金流入額	106,844	110,102	101,434	88,024
20	資金流入合計額	816,884	752,822	825,556	730,299
単体流動性カバレッジ比率 (4)					
21	算入可能適格流動資産の合計額		836,785		846,753
22	純資金流出額		619,107		633,524
23	単体流動性カバレッジ比率		135.1		133.6
24	平均値計算用データ数	58		62	

上記は、平成27年金融庁告示第7号の別紙様式第1号に基づく開示事項です。