

〈流動性カバレッジ比率に関する開示事項〉(2019年9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	867,244		829,171	
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	2,637,025	203,155	2,604,383	201,585
3	うち、安定預金の額	874,550	26,236	850,471	25,516
4	うち、準安定預金の額	1,762,474	176,902	1,753,911	176,053
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,623,607	1,160,146	1,527,928	1,022,986
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	1,514,456	1,050,995	1,452,375	947,433
8	うち、負債性有価証券の額	109,151	109,151	75,552	75,552
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		10,053		6,342
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	59,206	45,755	63,460	49,329
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	43,879	43,879	47,336	47,339
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	15,326	1,875	16,123	1,989
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	60,036	39,022	51,828	27,464
15	偶発事象に係る資金流出額	584,732	17,353	585,070	17,367
16	資金流出合計額		1,475,486		1,325,075
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	804,137	737,005	743,671	672,284
19	その他資金流入額	121,606	109,626	126,001	104,638
20	資金流入合計額	925,744	846,631	869,673	776,923
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		867,244		829,171
22	純資金流出額		629,258		548,152
23	連結流動性カバレッジ比率		137.8		151.2
24	平均値計算用データ数	62		59	

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	867,244		829,171	
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	2,637,025	203,155	2,604,690	201,585
3	うち、安定預金の額	874,550	26,236	850,549	25,516
4	うち、準安定預金の額	1,762,474	176,902	1,754,141	176,053
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,625,978	1,162,517	1,530,379	1,025,672
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	1,516,826	1,053,365	1,454,826	950,119
8	うち、負債性有価証券の額	109,151	109,151	75,552	75,552
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		10,053		6,342
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	59,206	45,755	63,463	49,329
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	43,879	43,879	47,339	47,339
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	15,326	1,875	16,123	1,989
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	58,288	37,273	51,652	25,773
15	偶発事象に係る資金流出額	569,318	16,880	569,313	16,884
16	資金流出合計額		1,475,636		1,325,587
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	803,891	738,365	743,716	673,753
19	その他資金流入額	121,616	109,635	126,068	104,377
20	資金流入合計額	925,507	848,000	869,784	778,130
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		867,244		829,171
22	純資金流出額		628,044		547,457
23	単体流動性カバレッジ比率		138.0		151.4
24	平均値計算用データ数	62		59	

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。