

〈流動性カバレッジ比率に関する開示事項〉(2019年12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	977,556		867,244	
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	2,653,535	204,932	2,637,025	203,155
3	うち、安定預金の額	873,131	26,196	874,550	26,236
4	うち、準安定預金の額	1,780,403	178,708	1,762,474	176,902
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,633,168	1,172,759	1,623,607	1,160,146
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	1,548,763	1,088,354	1,514,456	1,050,995
8	うち、負債性有価証券の額	84,404	84,404	109,151	109,151
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		10,429		10,053
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	55,412	41,591	59,206	45,755
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	39,675	39,675	43,879	43,879
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	15,737	1,916	15,326	1,875
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	69,835	48,636	60,036	39,022
15	偶発事象に係る資金流出額	575,701	17,070	584,732	17,353
16	資金流出合計額		1,495,420		1,475,486
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	788,565	732,582	804,137	737,005
19	その他資金流入額	93,873	84,787	121,606	109,626
20	資金流入合計額	882,439	817,369	925,744	846,631
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		977,556		867,244
22	純資金流出額		679,587		629,258
23	連結流動性カバレッジ比率		143.8		137.8
24	平均値計算用データ数	62		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	977,556		867,244	
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	2,653,535	204,932	2,637,025	203,155
3	うち、安定預金の額	873,131	26,196	874,550	26,236
4	うち、準安定預金の額	1,780,403	178,708	1,762,474	176,902
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,635,574	1,175,165	1,625,978	1,162,517
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	1,551,170	1,090,760	1,516,826	1,053,365
8	うち、負債性有価証券の額	84,404	84,404	109,151	109,151
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		10,429		10,053
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	55,412	41,591	59,206	45,755
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	39,675	39,675	43,879	43,879
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	15,737	1,916	15,326	1,875
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	68,076	46,877	58,288	37,273
15	偶発事象に係る資金流出額	560,878	16,616	569,318	16,880
16	資金流出合計額		1,495,613		1,475,636
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	788,804	734,405	803,891	738,365
19	その他資金流入額	93,882	84,795	121,616	109,635
20	資金流入合計額	882,687	819,201	925,507	848,000
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		977,556		867,244
22	純資金流出額		677,971		628,044
23	単体流動性カバレッジ比率		144.1		138.0
24	平均値計算用データ数	62		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。