

〈流動性カバレッジ比率に関する開示事項〉(平成30年3月期第1四半期)

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)					
1	適格流動資産の合計額	767,240		738,849	
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	2,463,600	193,782	2,454,080	192,909
3	うち、安定預金の額	760,296	22,808	759,352	22,780
4	うち、準安定預金の額	1,703,303	170,973	1,694,727	170,128
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	925,186	522,303	821,368	476,054
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	856,589	453,707	778,608	433,294
8	うち、負債性有価証券の額	68,596	68,596	42,759	42,759
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		1,663		3,503
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	66,873	51,906	70,854	57,825
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	50,147	50,147	56,204	56,204
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	16,726	1,759	14,649	1,621
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	53,952	31,432	45,213	32,624
15	偶発事象に係る資金流出額	528,094	15,627	523,895	15,501
16	資金流出合計額		816,716		778,418
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	213,200	192,110	141,898	131,363
19	その他資金流入額	146,933	97,070	164,957	116,313
20	資金流入合計額		289,181		247,676
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		767,240		738,849
22	純資金流出額		527,534		530,742
23	連結流動性カバレッジ比率		145.4		139.2
24	平均値計算用データ数	62		61	

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。

流動性カバレッジ比率は、中小・地域金融機関向けの総合的な監督指針「II-2-6-2」に定める「近似LCR」をもとに簡便的な計算を行い、開示しております。

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	767,240		738,849	
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	2,463,600	193,782	2,454,080	192,909
3	うち、安定預金の額	760,296	22,808	759,352	22,780
4	うち、準安定預金の額	1,703,303	170,973	1,694,727	170,128
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	928,260	525,378	823,339	478,024
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	859,663	456,781	780,579	435,265
8	うち、負債性有価証券の額	68,596	68,596	42,759	42,759
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		1,663		3,503
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	64,350	51,906	69,041	57,825
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	50,147	50,147	56,204	56,204
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	14,203	1,759	12,837	1,621
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	53,952	30,414	45,213	31,283
15	偶発事象に係る資金流出額	506,509	15,003	501,533	14,855
16	資金流出合計額		818,148		778,401
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	209,836	190,321	139,240	130,339
19	その他資金流入額	146,939	95,613	164,965	116,305
20	資金流入合計額		285,935		246,644
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		767,240		738,849
22	純資金流出額		532,213		531,757
23	単体流動性カバレッジ比率		144.1		138.9
24	平均値計算用データ数	62		61	

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。

流動性カバレッジ比率は、中小・地域金融機関向けの総合的な監督指針「II-2-6-2」に定める「近似LCR」をもとに簡便的な計算を行い、開示しております。

訂正 平成29年6月30日分 新旧対照表

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 訂正後		訂正前(29/4/27公表)	
		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
資金流出額 (2)					
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	2,463,600	193,782	2,213,493	193,766
3	うち、安定預金の額	760,296	22,808	655,687	22,808
4	うち、準安定預金の額	1,703,303	170,973	1,557,806	170,957
16	資金流出合計額		816,716		816,700
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		767,240		767,240
22	純資金流出額		527,534		527,519
23	連結流動性カバレッジ比率		145.4		145.4
24	平均値計算用データ数	62		62	

下線箇所を訂正しております。