

〈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 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	744,139		762,077	
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	2,527,156	197,246	2,504,623	196,340
3	うち、安定預金の額	802,100	24,063	782,802	23,484
4	うち、準安定預金の額	1,725,055	173,179	1,721,821	172,854
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,191,259	784,195	1,122,137	716,259
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	1,133,014	725,950	1,053,388	647,510
8	うち、負債性有価証券の額	58,244	58,244	68,748	68,748
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		3,085		1,412
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	40,460	28,129	39,895	28,077
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	26,424	26,424	26,349	26,349
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	14,035	1,705	13,546	1,728
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	51,447	40,599	61,771	49,317
15	偶発事象に係る資金流出額	581,554	17,230	576,847	17,091
16	資金流出合計額		1,073,366		1,009,617
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	582,651	517,997	443,415	382,263
19	その他資金流入額	71,155	57,601	75,239	70,227
20	資金流入合計額	653,807	575,599	518,655	452,491
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		744,139		762,077
22	純資金流出額		497,766		557,126
23	連結流動性カバレッジ比率		149.4		136.7
24	平均値計算用データ数	59		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	744,139		762,077	
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	2,527,156	197,246	2,504,623	196,340
3	うち、安定預金の額	802,100	24,063	782,802	23,484
4	うち、準安定預金の額	1,725,055	173,179	1,721,821	172,854
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,194,107	787,043	1,124,933	719,055
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	1,135,862	728,799	1,056,184	650,306
8	うち、負債性有価証券の額	58,244	58,244	68,748	68,748
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		3,085		1,412
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	40,460	28,129	39,895	28,077
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	26,424	26,424	26,349	26,349
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	14,035	1,705	13,546	1,728
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	51,447	38,962	61,771	47,739
15	偶発事象に係る資金流出額	561,167	16,635	556,494	16,496
16	資金流出合計額		1,073,983		1,010,240
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	580,429	517,347	440,937	381,377
19	その他資金流入額	71,162	57,591	75,246	70,105
20	資金流入合計額	651,592	574,939	516,184	451,482
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		744,139		762,077
22	純資金流出額		499,044		558,757
23	単体流動性カバレッジ比率		149.1		136.3
24	平均値計算用データ数	59		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。