

〈流動性カバレッジ比率に関する開示事項〉(平成31年3月期 第1四半期決算)

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	834,794		744,139	
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	2,530,814	197,601	2,527,156	197,246
3	うち、安定預金の額	802,525	24,075	802,100	24,063
4	うち、準安定預金の額	1,728,288	173,523	1,725,055	173,179
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,379,801	914,596	1,191,259	784,195
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	1,316,985	851,780	1,133,014	725,950
8	うち、負債性有価証券の額	62,816	62,816	58,244	58,244
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		1,421		3,085
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	49,848	37,010	40,460	28,129
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	35,248	35,248	26,424	26,424
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	14,599	1,761	14,035	1,705
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	67,455	41,546	51,447	40,599
15	偶発事象に係る資金流出額	590,728	17,544	581,554	17,230
16	資金流出合計額		1,209,722		1,073,366
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	748,801	673,928	582,651	517,997
19	その他資金流入額	66,399	46,230	71,155	57,601
20	資金流入合計額	815,200	720,158	653,807	575,599
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		834,794		744,139
22	純資金流出額		489,669		497,766
23	連結流動性カバレッジ比率		170.4		149.4
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	834,794		744,139	
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	2,530,814	197,601	2,527,156	197,246
3	うち、安定預金の額	802,525	24,075	802,100	24,063
4	うち、準安定預金の額	1,728,288	173,523	1,725,055	173,179
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,382,362	917,157	1,194,107	787,043
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	1,319,546	854,341	1,135,862	728,799
8	うち、負債性有価証券の額	62,816	62,816	58,244	58,244
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	1,421		3,085	
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	49,848	37,010	40,460	28,129
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	35,248	35,248	26,424	26,424
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	14,599	1,761	14,035	1,705
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	67,456	40,027	51,447	38,962
15	偶発事象に係る資金流出額	573,496	17,018	561,167	16,635
16	資金流出合計額	1,210,238		1,073,983	
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	747,907	674,551	580,429	517,347
19	その他資金流入額	66,407	46,227	71,162	57,591
20	資金流入合計額	814,314	720,779	651,592	574,939
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	834,794		744,139	
22	純資金流出額	489,585		499,044	
23	単体流動性カバレッジ比率	170.5		149.1	
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。