

〈流動性カバレッジ比率に関する開示事項〉(平成30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 平成30年9月		前四半期 平成30年6月	
		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
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	887,372		834,794	
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	2,561,572	199,168	2,530,814	197,601
3	うち、安定預金の額	823,901	24,717	802,525	24,075
4	うち、準安定預金の額	1,737,671	174,450	1,728,288	173,523
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,436,005	998,334	1,379,801	914,596
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	1,364,586	926,915	1,316,985	851,780
8	うち、負債性有価証券の額	71,419	71,419	62,816	62,816
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	1,177		1,421	
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	65,912	53,394	49,848	37,010
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	51,667	51,667	35,248	35,248
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	14,245	1,726	14,599	1,761
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	47,261	35,319	67,455	41,546
15	偶発事象に係る資金流出額	594,510	17,651	590,728	17,544
16	資金流出合計額	1,305,046		1,209,722	
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	683,059	612,943	748,801	673,928
19	その他資金流入額	80,502	64,358	66,399	46,230
20	資金流入合計額	763,562	677,301	815,200	720,158
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	887,372		834,794	
22	純資金流出額	627,744		489,669	
23	連結流動性カバレッジ比率	141.3		170.4	
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 平成30年9月		前四半期 平成30年6月	
		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
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	887,372		834,794	
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	2,561,572	199,168	2,530,814	197,601
3	うち、安定預金の額	823,901	24,717	802,525	24,075
4	うち、準安定預金の額	1,737,671	174,450	1,728,288	173,523
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,438,677	1,001,006	1,382,362	917,157
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	1,367,258	929,587	1,319,546	854,341
8	うち、負債性有価証券の額	71,419	71,419	62,816	62,816
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	1,177		1,421	
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	65,912	53,394	49,848	37,010
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	51,667	51,667	35,248	35,248
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	14,245	1,726	14,599	1,761
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	47,261	33,731	67,456	40,027
15	偶発事象に係る資金流出額	577,768	17,137	573,496	17,018
16	資金流出合計額	1,305,617		1,210,238	
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	681,320	612,818	747,907	674,551
19	その他資金流入額	80,510	64,347	66,407	46,227
20	資金流入合計額	761,830	677,165	814,314	720,779
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	887,372		834,794	
22	純資金流出額	628,451		489,585	
23	単体流動性カバレッジ比率	141.1		170.5	
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。