

〈流動性カバレッジ比率に関する開示事項〉(平成30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	846,753		887,372	
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	2,574,673	199,935	2,561,572	199,168
3	うち、安定預金の額	831,360	24,940	823,901	24,717
4	うち、準安定預金の額	1,743,313	174,987	1,737,671	174,450
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,511,550	1,072,165	1,436,005	998,334
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	1,453,888	1,014,504	1,364,586	926,915
8	うち、負債性有価証券の額	57,661	57,661	71,419	71,419
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	1,201		1,177	
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	52,376	40,594	65,912	53,394
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	38,926	38,926	51,667	51,667
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	13,449	1,668	14,245	1,726
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	42,071	32,263	47,261	35,319
15	偶発事象に係る資金流出額	589,783	17,507	594,510	17,651
16	資金流出合計額	1,363,669		1,305,046	
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	725,515	642,089	683,059	612,943
19	その他資金流入額	101,425	88,016	80,502	64,358
20	資金流入合計額	826,941	730,105	763,562	677,301
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	846,753		887,372	
22	純資金流出額	633,563		627,744	
23	連結流動性カバレッジ比率	133.6		141.3	
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	846,753		887,372	
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	2,574,673	199,935	2,561,572	199,168
3	うち、安定預金の額	831,360	24,940	823,901	24,717
4	うち、準安定預金の額	1,743,313	174,987	1,737,671	174,450
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,513,982	1,074,598	1,438,677	1,001,006
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	1,456,321	1,016,936	1,367,258	929,587
8	うち、負債性有価証券の額	57,661	57,661	71,419	71,419
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		1,201		1,177
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	52,376	40,594	65,912	53,394
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	38,926	38,926	51,667	51,667
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	13,449	1,668	14,245	1,726
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	42,071	30,487	47,261	33,731
15	偶発事象に係る資金流出額	573,448	17,006	577,768	17,137
16	資金流出合計額		1,363,824		1,305,617
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	724,122	642,275	681,320	612,818
19	その他資金流入額	101,434	88,024	80,510	64,347
20	資金流入合計額	825,556	730,299	761,830	677,165
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		846,753		887,372
22	純資金流出額		633,524		628,451
23	単体流動性カバレッジ比率		133.6		141.1
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。