

〈流動性カバレッジ比率に関する開示事項〉(2019年6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	829,171		836,785	
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	2,604,383	201,585	2,599,823	201,056
3	うち、安定預金の額	850,471	25,516	851,036	25,531
4	うち、準安定預金の額	1,753,911	176,053	1,748,786	175,512
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,527,928	1,022,986	1,506,406	1,066,133
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	1,452,375	947,433	1,458,506	1,018,234
8	うち、負債性有価証券の額	75,552	75,552	47,899	47,899
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		6,342		3,477
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	63,460	49,329	59,011	46,799
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	47,336	47,339	45,106	45,106
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	16,123	1,989	13,904	1,692
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	51,828	27,464	39,273	36,751
15	偶発事象に係る資金流出額	585,070	17,367	582,913	17,299
16	資金流出合計額		1,325,075		1,371,517
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	743,671	672,284	711,197	642,342
19	その他資金流入額	126,001	104,638	106,834	110,100
20	資金流入合計額	869,673	776,923	818,032	752,443
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		829,171		836,785
22	純資金流出額		548,152		619,073
23	連結流動性カバレッジ比率		151.2		135.1
24	平均値計算用データ数	59		58	

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	829,171		836,785	
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	2,604,690	201,585	2,599,823	201,056
3	うち、安定預金の額	850,549	25,516	851,036	25,531
4	うち、準安定預金の額	1,754,141	176,053	1,748,786	175,512
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,530,379	1,025,672	1,508,995	1,068,722
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	1,454,826	950,119	1,461,095	1,020,823
8	うち、負債性有価証券の額	75,552	75,552	47,899	47,899
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	6,342		3,477	
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	63,463	49,329	59,011	46,799
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	47,339	47,339	45,106	45,106
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	16,123	1,989	13,904	1,692
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	51,652	25,773	39,273	35,070
15	偶発事象に係る資金流出額	569,313	16,884	566,764	16,804
16	資金流出合計額	1,325,587		1,371,929	
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	743,716	673,753	710,040	642,720
19	その他資金流入額	126,068	104,377	106,844	110,102
20	資金流入合計額	869,784	778,130	816,884	752,822
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	829,171		836,785	
22	純資金流出額	547,457		619,107	
23	単体流動性カバレッジ比率	151.4		135.1	
24	平均値計算用データ数	59		58	

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。