

「流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項」

[連結]平成31年3月期 第1四半期(別紙様式第二号)

(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	1,485,749		1,376,027	
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	4,936,809	391,174	4,933,710	391,334
3	うち、安定預金の額	1,642,445	49,273	1,631,701	48,951
4	うち、準安定預金の額	3,294,363	341,900	3,302,009	342,383
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,602,980	731,063	1,430,055	652,990
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	1,462,377	590,459	1,306,767	529,702
8	うち、負債性有価証券の額	140,603	140,603	123,288	123,288
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		38,640		54,972
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	1,699,722	290,613	1,690,045	325,428
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	158,514	158,514	198,469	198,469
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	1,541,208	132,099	1,491,575	126,959
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	79,511	61,462	77,254	55,822
15	偶発事象に係る資金流出額	46,863	14,530	46,722	13,432
16	資金流出合計額		1,527,482		1,493,981
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	517,879	347,409	491,247	311,715
19	その他資金流入額	207,749	168,058	258,332	219,428
20	資金流入合計額	725,629	515,467	749,579	531,144
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		1,485,749		1,376,027
22	純資金流出額		1,012,015		962,837
23	連結流動性カバレッジ比率		146.8		142.9
24	平均値計算用データ数	62		59	

「流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項」

[単体]平成31年3月期 第1四半期(別紙様式第一号)

(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	1,485,749		1,376,027	
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	4,936,809	391,174	4,933,710	391,334
3	うち、安定預金の額	1,642,445	49,273	1,631,701	48,951
4	うち、準安定預金の額	3,294,363	341,900	3,302,009	342,383
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,612,211	740,294	1,439,135	662,070
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	1,471,035	599,118	1,315,206	538,140
8	うち、負債性有価証券の額	141,175	141,175	123,929	123,929
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		38,640		54,972
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	1,706,255	292,766	1,696,728	327,597
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	158,514	158,514	198,469	198,469
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	1,547,741	134,252	1,498,258	129,127
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	56,493	38,444	54,982	33,550
15	偶発事象に係る資金流出額	46,863	14,530	46,722	13,432
16	資金流出合計額		1,515,850		1,482,957
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	518,261	347,600	491,568	311,876
19	その他資金流入額	207,751	168,060	258,335	219,430
20	資金流入合計額	726,013	515,661	749,903	531,307
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		1,485,749		1,376,027
22	純資金流出額		1,000,188		951,649
23	単体流動性カバレッジ比率		148.5		144.5
24	平均値計算用データ数	62		59	