

「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30年3月期 第4四半期(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	1,376,027		1,370,374	
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	4,933,710	391,334	4,901,931	392,066
3	うち、安定預金の額	1,631,701	48,951	1,576,366	47,290
4	うち、準安定預金の額	3,302,009	342,383	3,325,565	344,775
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,430,055	652,990	1,432,227	658,173
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	1,306,767	529,702	1,310,646	536,591
8	うち、負債性有価証券の額	123,288	123,288	121,581	121,581
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		54,972		46,212
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	1,690,045	325,428	1,671,443	288,832
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	198,469	198,469	159,571	159,571
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	1,491,575	126,959	1,511,872	129,260
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	77,254	55,822	63,019	53,364
15	偶発事象に係る資金流出額	46,722	13,432	47,887	13,538
16	資金流出合計額		1,493,981		1,452,187
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	491,247	311,715	504,205	333,576
19	その他資金流入額	258,332	219,428	220,731	178,261
20	資金流入合計額	749,579	531,144	724,937	511,838
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		1,376,027		1,370,374
22	純資金流出額		962,837		940,348
23	連結流動性カバレッジ比率		142.9		145.7
24	平均値計算用データ数	59		62	

「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30年3月期 第4四半期(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	1,376,027		1,370,374	
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	4,933,710	391,334	4,901,931	392,066
3	うち、安定預金の額	1,631,701	48,951	1,576,366	47,290
4	うち、準安定預金の額	3,302,009	342,383	3,325,565	344,775
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,439,135	662,070	1,442,349	668,294
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	1,315,206	538,140	1,320,241	546,186
8	うち、負債性有価証券の額	123,929	123,929	122,108	122,108
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		54,972		46,212
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	1,696,728	327,597	1,678,266	291,014
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	198,469	198,469	159,571	159,571
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	1,498,258	129,127	1,518,694	131,442
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	54,982	33,550	42,079	32,424
15	偶発事象に係る資金流出額	46,722	13,432	47,887	13,538
16	資金流出合計額		1,482,957		1,443,551
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	491,568	311,876	504,407	333,677
19	その他資金流入額	258,335	219,430	220,734	178,264
20	資金流入合計額	749,903	531,307	725,141	511,941
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		1,376,027		1,370,374
22	純資金流出額		951,649		931,609
23	単体流動性カバレッジ比率		144.5		147.0
24	平均値計算用データ数	59		62	