

Ⅲ. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項【連結・単体共通】

1. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項【連結】

(単位：百万円、%、件)

項目		平成29年度第4四半期 (平成30年1月1日から平成30年3月31日まで)		平成29年度第3四半期 (平成29年10月1日から平成29年12月31日まで)	
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	

流動性に係る経営の健全性の状況

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項【連結・単体共通】

2. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項【単体】

(単位：百万円、%、件)

項目		平成29年度第4四半期 (平成30年1月1日から平成30年3月31日まで)		平成29年度第3四半期 (平成29年10月1日から平成29年12月31日まで)	
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	