

「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2四半期(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	1,462,305		1,485,749	
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	5,005,084	402,236	4,936,809	391,174
3	うち、安定預金の額	1,580,023	47,400	1,642,445	49,273
4	うち、準安定預金の額	3,425,060	354,835	3,294,363	341,900
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,514,737	688,796	1,602,980	731,063
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	1,348,952	523,011	1,462,377	590,459
8	うち、負債性有価証券の額	165,785	165,785	140,603	140,603
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		21,149		38,640
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	1,692,129	265,047	1,699,722	290,613
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	130,760	130,760	158,514	158,514
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	1,561,369	134,287	1,541,208	132,099
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	61,069	50,229	79,511	61,462
15	偶発事象に係る資金流出額	47,701	14,846	46,863	14,530
16	資金流出合計額		1,442,305		1,527,482
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	522,294	363,886	517,879	347,409
19	その他資金流入額	159,105	136,385	207,749	168,058
20	資金流入合計額	681,400	500,271	725,629	515,467
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		1,462,305		1,485,749
22	純資金流出額		942,033		1,012,015
23	連結流動性カバレッジ比率		155.2		146.8
24	平均値計算用データ数	62		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31年3月期 第2四半期(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	1,462,305		1,485,749	
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	5,005,084	402,236	4,936,809	391,174
3	うち、安定預金の額	1,580,023	47,400	1,642,445	49,273
4	うち、準安定預金の額	3,425,060	354,835	3,294,363	341,900
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,523,674	697,733	1,612,211	740,294
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	1,357,469	531,528	1,471,035	599,118
8	うち、負債性有価証券の額	166,205	166,205	141,175	141,175
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		21,149		38,640
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	1,698,842	267,257	1,706,255	292,766
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	130,803	130,803	158,514	158,514
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	1,568,039	136,454	1,547,741	134,252
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	39,911	29,071	56,493	38,444
15	偶発事象に係る資金流出額	47,701	14,846	46,863	14,530
16	資金流出合計額		1,432,294		1,515,850
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	522,633	364,055	518,261	347,600
19	その他資金流入額	159,151	136,431	207,751	168,060
20	資金流入合計額	681,784	500,486	726,013	515,661
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		1,462,305		1,485,749
22	純資金流出額		931,808		1,000,188
23	単体流動性カバレッジ比率		156.9		148.5
24	平均値計算用データ数	62		62	