

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		2018年度第4四半期 (2019年1月1日から2019年3月31日まで)		2018年度第3四半期 (2018年10月1日から2018年12月31日まで)	
		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
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,345,964		1,443,913	
資金流出額 (2)					
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	5,043,463	404,143	5,023,185	403,436
3	うち、安定預金の額	1,605,362	48,160	1,587,468	47,624
4	うち、準安定預金の額	3,438,101	355,982	3,435,716	355,812
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,510,558	695,542	1,539,178	711,363
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	1,351,623	536,607	1,382,228	554,414
8	うち、負債性有価証券の額	158,934	158,934	156,949	156,949
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	—	7,627	—	10,756
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	1,617,222	237,354	1,688,484	276,321
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	108,647	108,647	143,804	143,804
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	1,508,574	128,706	1,544,680	132,516
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	71,440	53,678	70,640	59,937
15	偶発事象に係る資金流出額	47,500	15,028	48,616	14,608
16	資金流出合計額	—	1,413,373	—	1,476,424
資金流入額 (3)					
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	569,774	390,948	545,465	382,753
19	その他資金流入額	165,399	135,726	195,631	167,674
20	資金流入合計額	735,174	526,674	741,096	550,428
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	—	1,345,964	—	1,443,913
22	純資金流出額	—	886,698	—	925,995
23	連結流動性カバレッジ比率	—	151.7	—	155.9
24	平均値計算用データ数	58		62	

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		2018年度第4四半期 (2019年1月1日から2019年3月31日まで)		2018年度第3四半期 (2018年10月1日から2018年12月31日まで)	
		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
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,345,964		1,443,913	
資金流出額 (2)					
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	5,043,463	404,143	5,023,185	403,436
3	うち、安定預金の額	1,605,362	48,160	1,587,468	47,624
4	うち、準安定預金の額	3,438,101	355,982	3,435,716	355,812
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,519,805	704,788	1,547,982	720,168
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	1,359,900	544,884	1,390,420	562,606
8	うち、負債性有価証券の額	159,904	159,904	157,561	157,561
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	—	7,627	—	10,756
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	1,624,162	239,552	1,695,151	278,496
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	108,653	108,653	143,813	143,813
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	1,515,509	130,899	1,551,338	134,682
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	49,222	31,460	48,800	38,096
15	偶発事象に係る資金流出額	47,500	15,028	48,616	14,608
16	資金流出合計額	—	1,402,601	—	1,465,562
資金流入額 (3)					
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	570,064	391,093	545,853	382,948
19	その他資金流入額	165,408	135,734	195,642	167,686
20	資金流入合計額	735,473	526,828	741,496	550,634
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	—	1,345,964	—	1,443,913
22	純資金流出額	—	875,772	—	914,928
23	単体流動性カバレッジ比率	—	153.6	—	157.8
24	平均値計算用データ数	58		62	