

「流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項」

[連結]2019年3月期 第3四半期(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	1,443,913		1,462,305	
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	5,023,185	403,436	5,005,084	402,236
3	うち、安定預金の額	1,587,468	47,624	1,580,023	47,400
4	うち、準安定預金の額	3,435,716	355,812	3,425,060	354,835
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,539,178	711,363	1,514,737	688,796
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	1,382,228	554,414	1,348,952	523,011
8	うち、負債性有価証券の額	156,949	156,949	165,785	165,785
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		10,756		21,149
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	1,688,484	276,321	1,692,129	265,047
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	143,804	143,804	130,760	130,760
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	1,544,680	132,516	1,561,369	134,287
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	70,640	59,937	61,069	50,229
15	偶発事象に係る資金流出額	48,616	14,608	47,701	14,846
16	資金流出合計額		1,476,424		1,442,305
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	545,465	382,753	522,294	363,886
19	その他資金流入額	195,631	167,674	159,105	136,385
20	資金流入合計額	741,096	550,428	681,400	500,271
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		1,443,913		1,462,305
22	純資金流出額		925,995		942,033
23	連結流動性カバレッジ比率		155.9		155.2
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]2019年3月期 第3四半期(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	1,443,913		1,462,305	
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	5,023,185	403,436	5,005,084	402,236
3	うち、安定預金の額	1,587,468	47,624	1,580,023	47,400
4	うち、準安定預金の額	3,435,716	355,812	3,425,060	354,835
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,547,982	720,168	1,523,674	697,733
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	1,390,420	562,606	1,357,469	531,528
8	うち、負債性有価証券の額	157,561	157,561	166,205	166,205
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		10,756		21,149
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	1,695,151	278,496	1,698,842	267,257
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	143,813	143,813	130,803	130,803
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	1,551,338	134,682	1,568,039	136,454
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	48,800	38,096	39,911	29,071
15	偶発事象に係る資金流出額	48,616	14,608	47,701	14,846
16	資金流出合計額		1,465,562		1,432,294
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	545,853	382,948	522,633	364,055
19	その他資金流入額	195,642	167,686	159,151	136,431
20	資金流入合計額	741,496	550,634	681,784	500,486
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		1,443,913		1,462,305
22	純資金流出額		914,928		931,808
23	単体流動性カバレッジ比率		157.8		156.9
24	平均値計算用データ数	62		62	