

「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12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	1,517,034		1,492,651	
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	5,097,516	407,116	5,091,149	406,461
3	うち、安定預金の額	1,642,356	49,270	1,640,987	49,229
4	うち、準安定預金の額	3,455,159	357,846	3,450,162	357,231
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,553,957	683,241	1,543,795	688,463
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	1,419,398	548,682	1,419,242	563,909
8	うち、負債性有価証券の額	134,559	134,559	124,553	124,553
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		11,351		6,712
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	1,632,791	241,527	1,625,718	230,288
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	110,144	110,144	98,879	98,879
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	1,522,647	131,382	1,526,838	131,409
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	62,781	53,828	65,675	58,526
15	偶発事象に係る資金流出額	48,077	13,568	46,726	13,887
16	資金流出合計額		1,410,633		1,404,340
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	539,917	385,036	521,674	360,475
19	その他資金流入額	168,471	140,185	155,058	125,218
20	資金流入合計額	708,388	525,222	676,732	485,694
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		1,517,034		1,492,651
22	純資金流出額		885,411		918,646
23	連結流動性カバレッジ比率		171.3		162.4
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12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	1,517,034		1,492,651	
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	5,097,516	407,116	5,091,149	406,461
3	うち、安定預金の額	1,642,356	49,270	1,640,987	49,229
4	うち、準安定預金の額	3,455,159	357,846	3,450,162	357,231
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,563,227	692,511	1,552,367	697,035
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	1,427,865	557,149	1,427,072	571,740
8	うち、負債性有価証券の額	135,362	135,362	125,295	125,295
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		11,351		6,712
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	1,639,852	243,734	1,632,479	232,475
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	110,145	110,145	98,891	98,891
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	1,529,706	133,588	1,533,587	133,583
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	40,333	31,381	43,139	35,990
15	偶発事象に係る資金流出額	48,077	13,568	46,726	13,887
16	資金流出合計額		1,399,663		1,392,563
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	540,137	385,146	522,079	360,678
19	その他資金流入額	168,476	140,190	155,074	125,234
20	資金流入合計額	708,613	525,336	677,154	485,912
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		1,517,034		1,492,651
22	純資金流出額		874,327		906,651
23	単体流動性カバレッジ比率		173.5		164.6
24	平均値計算用データ数	62		62	