

「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4四半期(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	1,345,964		1,443,913	
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	5,043,463	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)		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	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	

「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4四半期(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	1,345,964		1,443,913	
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	5,043,463	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)		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	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	