

「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6月期 第1四半期(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	1,447,818		1,345,964	
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	5,047,754	404,696	5,043,463	404,143
3	うち、安定預金の額	1,602,787	48,083	1,605,362	48,160
4	うち、準安定預金の額	3,444,966	356,613	3,438,101	355,982
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,564,235	673,439	1,510,558	695,542
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	1,462,426	571,629	1,351,623	536,607
8	うち、負債性有価証券の額	101,809	101,809	158,934	158,934
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		6,814		7,627
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	1,615,282	224,823	1,617,222	237,354
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	94,230	94,230	108,647	108,647
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	1,521,051	130,592	1,508,574	128,706
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	77,494	69,770	71,440	53,678
15	偶発事象に係る資金流出額	45,298	14,464	47,500	15,028
16	資金流出合計額		1,394,008		1,413,373
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	552,620	376,499	569,774	390,948
19	その他資金流入額	156,342	120,234	165,399	135,726
20	資金流入合計額	708,962	496,734	735,174	526,674
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		1,447,818		1,345,964
22	純資金流出額		897,274		886,698
23	連結流動性カバレッジ比率		161.3		151.7
24	平均値計算用データ数	59		58	

「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6月期 第1四半期(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	1,447,818		1,345,964	
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	5,047,754	404,696	5,043,463	404,143
3	うち、安定預金の額	1,602,787	48,083	1,605,362	48,160
4	うち、準安定預金の額	3,444,966	356,613	3,438,101	355,982
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,573,181	682,384	1,519,805	704,788
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	1,470,795	579,999	1,359,900	544,884
8	うち、負債性有価証券の額	102,385	102,385	159,904	159,904
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		6,814		7,627
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	1,622,083	227,018	1,624,162	239,552
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	94,247	94,247	108,653	108,653
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	1,527,836	132,771	1,515,509	130,899
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	54,841	47,117	49,222	31,460
15	偶発事象に係る資金流出額	45,298	14,464	47,500	15,028
16	資金流出合計額		1,382,496		1,402,601
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	552,958	376,669	570,064	391,093
19	その他資金流入額	156,362	120,253	165,408	135,734
20	資金流入合計額	709,320	496,923	735,473	526,828
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		1,447,818		1,345,964
22	純資金流出額		885,573		875,772
23	単体流動性カバレッジ比率		163.4		153.6
24	平均値計算用データ数	59		58	