

「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9月期 第2四半期(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	1,492,651		1,447,818	
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	5,091,149	406,461	5,047,754	404,696
3	うち、安定預金の額	1,640,987	49,229	1,602,787	48,083
4	うち、準安定預金の額	3,450,162	357,231	3,444,966	356,613
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,543,795	688,463	1,564,235	673,439
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	1,419,242	563,909	1,462,426	571,629
8	うち、負債性有価証券の額	124,553	124,553	101,809	101,809
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		6,712		6,814
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	1,625,718	230,288	1,615,282	224,823
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	98,879	98,879	94,230	94,230
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	1,526,838	131,409	1,521,051	130,592
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	65,675	58,526	77,494	69,770
15	偶発事象に係る資金流出額	46,726	13,887	45,298	14,464
16	資金流出合計額		1,404,340		1,394,008
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	521,674	360,475	552,620	376,499
19	その他資金流入額	155,058	125,218	156,342	120,234
20	資金流入合計額	676,732	485,694	708,962	496,734
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		1,492,651		1,447,818
22	純資金流出額		918,646		897,274
23	連結流動性カバレッジ比率		162.4		161.3
24	平均値計算用データ数	62		59	

「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9月期 第2四半期(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	1,492,651		1,447,818	
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	5,091,149	406,461	5,047,754	404,696
3	うち、安定預金の額	1,640,987	49,229	1,602,787	48,083
4	うち、準安定預金の額	3,450,162	357,231	3,444,966	356,613
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,552,367	697,035	1,573,181	682,384
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	1,427,072	571,740	1,470,795	579,999
8	うち、負債性有価証券の額	125,295	125,295	102,385	102,385
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		6,712		6,814
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	1,632,479	232,475	1,622,083	227,018
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	98,891	98,891	94,247	94,247
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	1,533,587	133,583	1,527,836	132,771
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	43,139	35,990	54,841	47,117
15	偶発事象に係る資金流出額	46,726	13,887	45,298	14,464
16	資金流出合計額		1,392,563		1,382,496
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	522,079	360,678	552,958	376,669
19	その他資金流入額	155,074	125,234	156,362	120,253
20	資金流入合計額	677,154	485,912	709,320	496,923
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		1,492,651		1,447,818
22	純資金流出額		906,651		885,573
23	単体流動性カバレッジ比率		164.6		163.4
24	平均値計算用データ数	62		59	