

<流動性規制に関する開示>

連結流動性カバレッジ比率に関する定量的事項(2019年3月期 第4四半期)

(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	1,430,392		1,484,412	
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	3,670,761	292,781	3,661,548	292,920
3	うち、安定預金の額	1,067,690	32,030	1,052,933	31,587
4	うち、準安定預金の額	2,602,970	260,751	2,608,524	261,332
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,716,416	1,042,115	1,698,629	1,056,748
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	1,451,466	777,165	1,446,334	804,452
8	うち、負債性有価証券の額	264,950	264,950	252,295	252,295
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		-		-
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	1,401,828	300,639	1,433,484	329,087
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	187,373	187,373	216,627	216,627
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	1,214,454	113,265	1,216,856	112,460
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	2,628	954	3,998	2,535
15	偶発事象に係る資金流出額	43,470	9,190	42,065	9,502
16	資金流出合計額		1,645,681		1,690,794
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	384,441	210,164	333,388	178,773
19	その他資金流入額	216,054	201,538	225,721	208,705
20	資金流入合計額	600,496	411,702	559,109	387,479
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		1,430,392		1,484,412
22	純資金流出額		1,233,979		1,303,315
23	連結流動性カバレッジ比率		115.9%		113.8%
24	平均値計算用データ数	58件		62件	

<流動性規制に関する開示>

単体流動性カバレッジ比率に関する定量的事項(2019年3月期 第4四半期)

(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	1,430,392		1,484,412	
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	3,670,761	292,781	3,661,548	292,920
3	うち、安定預金の額	1,067,690	32,030	1,052,933	31,587
4	うち、準安定預金の額	2,602,970	260,751	2,608,524	261,332
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,705,500	1,031,199	1,687,807	1,045,926
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	1,439,266	764,965	1,434,941	793,059
8	うち、負債性有価証券の額	266,234	266,234	252,866	252,866
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		-		-
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	1,401,828	300,639	1,433,484	329,087
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	187,373	187,373	216,627	216,627
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	1,214,454	113,265	1,216,856	112,460
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	2,628	954	3,998	2,535
15	偶発事象に係る資金流出額	43,470	9,190	42,065	9,502
16	資金流出合計額		1,634,765		1,679,973
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	395,564	221,282	344,399	189,784
19	その他資金流入額	216,059	201,542	225,726	208,710
20	資金流入合計額	611,623	422,824	570,125	398,494
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		1,430,392		1,484,412
22	純資金流出額		1,211,940		1,281,478
23	単体流動性カバレッジ比率		118.0%		115.8%
24	平均値計算用データ数	58件		62件	

<流動性規制に関する開示>

(KM1 主要な指標)

連結流動性カバレッジ比率に関する定量的事項(2019年3月期 第4四半期)

(単位:百万円、%)

国際様式の 該当番号		2019年3月期	2018年12月期	2018年9月期	2018年6月期	2018年3月期
連結流動性カバレッジ比率						
15	算入可能適格流動性資産の合計額	1,430,392	1,484,412	1,407,791	1,454,618	1,364,645
16	純資金流出額	1,233,979	1,303,315	1,269,999	1,248,147	1,192,658
17	連結流動性カバレッジ比率	115.9%	113.8%	110.8%	116.5%	114.4%

単体流動性カバレッジ比率に関する定量的事項(2019年3月期 第4四半期)

(単位:百万円、%)

国際様式の 該当番号		2019年3月期	2018年12月期	2018年9月期	2018年6月期	2018年3月期
単体流動性カバレッジ比率						
15	算入可能適格流動性資産の合計額	1,430,392	1,484,412	1,407,791	1,454,618	1,364,645
16	純資金流出額	1,211,940	1,281,478	1,249,516	1,228,149	1,168,408
17	単体流動性カバレッジ比率	118.0%	115.8%	112.6%	118.4%	116.7%