

<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1四半期)

(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	1,454,618		1,364,645	
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	3,643,919	292,619	3,638,375	291,867
3	うち、安定預金の額	1,032,585	30,977	1,035,033	31,051
4	うち、準安定預金の額	2,610,919	261,642	2,602,731	260,816
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,690,693	1,033,244	1,677,788	1,036,471
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	1,439,387	781,939	1,425,645	784,329
8	うち、負債性有価証券の額	251,305	251,305	252,142	252,142
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	1,413,717	315,560	1,393,386	315,421
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	204,657	204,657	207,256	207,256
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	1,209,059	110,902	1,186,129	108,165
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	4,389	3,022	11,669	9,429
15	偶発事象に係る資金流出額	36,549	7,514	36,420	4,396
16	資金流出合計額		1,651,961		1,657,586
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	168	-	24	24
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	331,666	182,539	414,584	248,420
19	その他資金流入額	241,136	221,274	241,083	216,482
20	資金流入合計額	572,971	403,813	655,692	464,927
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		1,454,618		1,364,645
22	純資金流出額		1,248,147		1,192,658
23	連結流動性カバレッジ比率		116.5%		114.4%
24	平均値計算用データ数	62件		59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1四半期)

(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	1,454,618		1,364,645	
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	3,643,919	292,619	3,638,375	291,867
3	うち、安定預金の額	1,032,585	30,977	1,035,033	31,051
4	うち、準安定預金の額	2,610,919	261,642	2,602,731	260,816
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,681,886	1,024,438	1,665,245	1,023,929
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	1,429,956	772,508	1,412,066	770,749
8	うち、負債性有価証券の額	251,929	251,929	253,179	253,179
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	1,413,717	315,560	1,393,386	315,421
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	204,657	204,657	207,256	207,256
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	1,209,059	110,902	1,186,129	108,165
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	4,389	3,022	11,669	9,429
15	偶発事象に係る資金流出額	36,549	7,514	36,420	4,396
16	資金流出合計額		1,643,155		1,645,044
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	168	-	24	24
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	342,854	193,726	426,292	260,123
19	その他資金流入額	241,140	221,278	241,088	216,487
20	資金流入合計額	584,163	415,005	667,405	476,635
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		1,454,618		1,364,645
22	純資金流出額		1,228,149		1,168,408
23	単体流動性カバレッジ比率		118.4%		116.7%
24	平均値計算用データ数	62件		59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1四半期)

(単位:百万円、%)

国際様式の 該当番号		2018年6月期	2018年3月期	2017年12月期	2017年9月期	2017年6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	1,454,618	1,364,645	1,348,966	1,322,368	1,241,114
16	純資金流出額	1,248,147	1,192,658	1,080,867	978,313	933,544
17	連結流動性カバレッジ比率	116.5%	114.4%	124.8%	135.1%	132.9%

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1四半期)

(単位:百万円、%)

国際様式の 該当番号		2018年6月期	2018年3月期	2017年12月期	2017年9月期	2017年6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	1,454,618	1,364,645	1,348,966	1,322,368	1,241,114
16	純資金流出額	1,228,149	1,168,408	1,058,496	956,894	913,071
17	単体流動性カバレッジ比率	118.4%	116.7%	127.4%	138.1%	135.9%