

<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2四半期)

(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	1,407,791		1,454,618	
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	3,667,513	293,472	3,643,919	292,619
3	うち、安定預金の額	1,053,819	31,614	1,032,585	30,977
4	うち、準安定預金の額	2,613,535	261,857	2,610,919	261,642
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,686,116	1,050,025	1,690,693	1,033,244
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	1,437,992	801,901	1,439,387	781,939
8	うち、負債性有価証券の額	248,124	248,124	251,305	251,305
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	1,412,765	312,169	1,413,717	315,560
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	200,019	200,019	204,657	204,657
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	1,212,746	112,150	1,209,059	110,902
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	3,363	2,277	4,389	3,022
15	偶発事象に係る資金流出額	39,732	9,171	36,549	7,514
16	資金流出合計額		1,667,117		1,651,961
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	6,912	-	168	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	353,840	192,184	331,666	182,539
19	その他資金流入額	217,300	204,933	241,136	221,274
20	資金流入合計額	578,053	397,117	572,971	403,813
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		1,407,791		1,454,618
22	純資金流出額		1,269,999		1,248,147
23	連結流動性カバレッジ比率		110.8%		116.5%
24	平均値計算用データ数	62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2四半期)

(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	1,407,791		1,454,618	
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	3,667,513	293,472	3,643,919	292,619
3	うち、安定預金の額	1,053,819	31,614	1,032,585	30,977
4	うち、準安定預金の額	2,613,535	261,857	2,610,919	261,642
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,676,795	1,040,704	1,681,886	1,024,438
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	1,427,606	791,515	1,429,956	772,508
8	うち、負債性有価証券の額	249,188	249,188	251,929	251,929
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	1,412,765	312,169	1,413,717	315,560
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	200,019	200,019	204,657	204,657
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	1,212,746	112,150	1,209,059	110,902
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	3,363	2,277	4,389	3,022
15	偶発事象に係る資金流出額	39,732	9,171	36,549	7,514
16	資金流出合計額		1,657,796		1,643,155
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	6,912	-	168	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	365,003	203,342	342,854	193,726
19	その他資金流入額	217,305	204,937	241,140	221,278
20	資金流入合計額	589,221	408,280	584,163	415,005
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		1,407,791		1,454,618
22	純資金流出額		1,249,516		1,228,149
23	単体流動性カバレッジ比率		112.6%		118.4%
24	平均値計算用データ数	62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2四半期)

(単位:百万円、%)

国際様式の 該当番号		2018年9月期	2018年6月期	2018年3月期	2017年12月期	2017年9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	1,407,791	1,454,618	1,364,645	1,348,966	1,322,368
16	純資金流出額	1,269,999	1,248,147	1,192,658	1,080,867	978,313
17	連結流動性カバレッジ比率	110.8%	116.5%	114.4%	124.8%	135.1%

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2四半期)

(単位:百万円、%)

国際様式の 該当番号		2018年9月期	2018年6月期	2018年3月期	2017年12月期	2017年9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	1,407,791	1,454,618	1,364,645	1,348,966	1,322,368
16	純資金流出額	1,249,516	1,228,149	1,168,408	1,058,496	956,894
17	単体流動性カバレッジ比率	112.6%	118.4%	116.7%	127.4%	138.1%