

<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3四半期)

(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	1,484,412		1,407,791	
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	3,661,548	292,920	3,667,513	293,472
3	うち、安定預金の額	1,052,933	31,587	1,053,819	31,614
4	うち、準安定預金の額	2,608,524	261,332	2,613,535	261,857
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,698,629	1,056,748	1,686,116	1,050,025
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	1,446,334	804,452	1,437,992	801,901
8	うち、負債性有価証券の額	252,295	252,295	248,124	248,124
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	1,433,484	329,087	1,412,765	312,169
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	216,627	216,627	200,019	200,019
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	1,216,856	112,460	1,212,746	112,150
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	3,998	2,535	3,363	2,277
15	偶発事象に係る資金流出額	42,065	9,502	39,732	9,171
16	資金流出合計額		1,690,794		1,667,117
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	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	333,388	178,773	353,840	192,184
19	その他資金流入額	225,721	208,705	217,300	204,933
20	資金流入合計額	559,109	387,479	578,053	397,117
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		1,484,412		1,407,791
22	純資金流出額		1,303,315		1,269,999
23	連結流動性カバレッジ比率		113.8%		110.8%
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3四半期)

(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	1,484,412		1,407,791	
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	3,661,548	292,920	3,667,513	293,472
3	うち、安定預金の額	1,052,933	31,587	1,053,819	31,614
4	うち、準安定預金の額	2,608,524	261,332	2,613,535	261,857
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,687,807	1,045,926	1,676,795	1,040,704
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	1,434,941	793,059	1,427,606	791,515
8	うち、負債性有価証券の額	252,866	252,866	249,188	249,188
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	1,433,484	329,087	1,412,765	312,169
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	216,627	216,627	200,019	200,019
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	1,216,856	112,460	1,212,746	112,150
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	3,998	2,535	3,363	2,277
15	偶発事象に係る資金流出額	42,065	9,502	39,732	9,171
16	資金流出合計額		1,679,973		1,657,796
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	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	344,399	189,784	365,003	203,342
19	その他資金流入額	225,726	208,710	217,305	204,937
20	資金流入合計額	570,125	398,494	589,221	408,280
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		1,484,412		1,407,791
22	純資金流出額		1,281,478		1,249,516
23	単体流動性カバレッジ比率		115.8%		112.6%
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3四半期)

(単位:百万円、%)

国際様式の 該当番号		2018年12月期	2018年9月期	2018年6月期	2018年3月期	2017年12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	1,484,412	1,407,791	1,454,618	1,364,645	1,348,966
16	純資金流出額	1,303,315	1,269,999	1,248,147	1,192,658	1,080,867
17	連結流動性カバレッジ比率	113.8%	110.8%	116.5%	114.4%	124.8%

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3四半期)

(単位:百万円、%)

国際様式の 該当番号		2018年12月期	2018年9月期	2018年6月期	2018年3月期	2017年12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	1,484,412	1,407,791	1,454,618	1,364,645	1,348,966
16	純資金流出額	1,281,478	1,249,516	1,228,149	1,168,408	1,058,496
17	単体流動性カバレッジ比率	115.8%	112.6%	118.4%	116.7%	127.4%