

単体流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項(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 | 2,595,608 | | 2,354,795 | |
| 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 | 9,056,892 | 730,852 | 9,007,757 | 725,715 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 2,497,666 | 74,929 | 2,500,865 | 75,025 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 6,559,225 | 655,922 | 6,506,891 | 650,689 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 2,615,429 | 1,107,744 | 2,505,769 | 1,139,325 |
| 6 | うち、適格オペレーショナル預金の額 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 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 | 2,438,419 | 930,734 | 2,305,359 | 938,915 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 177,009 | 177,009 | 200,410 | 200,410 |
| 9 | 有担保資金調達等に係る資金流出額 | | 1,441 | | 2,388 |
| 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 | 1,617,221 | 160,824 | 1,638,412 | 181,006 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 49,050 | 49,050 | 70,291 | 70,291 |
| 12 | うち、資金調達プログラムに係る資金流出額 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 13 | うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額 | 1,568,170 | 111,773 | 1,568,121 | 110,714 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 27,641 | 16,968 | 26,395 | 18,489 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 1,687,204 | 69,245 | 1,662,464 | 70,008 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 2,087,076 | | 2,136,933 |
| 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 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 18 | 貸付金等の回収に係る資金流入額 | 435,002 | 290,639 | 486,600 | 327,930 |
| 19 | その他資金流入額 | 148,995 | 121,122 | 170,048 | 151,503 |
| 20 | 資金流入合計額 | 583,997 | 411,762 | 656,649 | 479,434 |
| 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 | | 2,595,608 | | 2,354,795 |
| 22 | 純資金流出額 | | 1,675,314 | | 1,657,499 |
| 23 | 単体流動性カバレッジ比率 | | 154.9 | | 142.0 |
| 24 | 平均値計算用データ数 | | 62 | | 59 |