

Ⅲ. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

1. 連結流動性カバレッジ比率

(単位：百万円、%、件)

項 目		2018年3月期		2017年12月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,101,210		1,113,303	
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	4,692,116	399,001	4,657,324	396,384
3	うち、安定預金の額	1,011,411	30,342	999,415	29,982
4	うち、準安定預金の額	3,680,704	368,659	3,657,909	366,402
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,536,486	631,340	1,487,569	589,759
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	1,439,876	534,730	1,407,403	509,593
8	うち、負債性有価証券の額	96,610	96,610	80,166	80,166
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	12,230		4,315	
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	100,376	28,116	98,985	24,260
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	17,261	17,261	13,466	13,466
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	83,115	10,855	85,519	10,794
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	34,980	27,106	28,574	27,089
15	偶発事象に係る資金流出額	1,241,504	27,534	1,247,220	27,179
16	資金流出合計額	1,125,331		1,068,989	
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	309,552	171,605	312,512	172,275
19	その他資金流入額	49,127	16,032	56,671	26,629
20	資金流入合計額	358,679	187,638	369,183	198,904
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	1,101,210		1,113,303	
22	純資金流出額	937,692		870,084	
23	連結流動性カバレッジ比率	117.4%		127.9%	
24	平均値計算用データ数	59		62	

2. 単体流動性カバレッジ比率

(単位：百万円、%、件)

項 目		2018年3月期		2017年12月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,101,210		1,113,303	
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	4,692,116	399,001	4,657,324	396,384
3	うち、安定預金の額	1,011,411	30,342	999,415	29,982
4	うち、準安定預金の額	3,680,704	368,659	3,657,909	366,402
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,544,740	639,594	1,495,219	597,409
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	1,446,181	541,035	1,413,192	515,382
8	うち、負債性有価証券の額	98,559	98,559	82,027	82,027
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	12,230		4,315	
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	100,376	28,116	98,985	24,260
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	17,261	17,261	13,466	13,466
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	83,115	10,855	85,519	10,794
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	11,609	3,735	6,754	5,269
15	偶発事象に係る資金流出額	1,246,213	27,534	1,251,747	27,179
16	資金流出合計額	1,110,214		1,054,819	
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	320,478	182,530	323,504	183,267
19	その他資金流入額	49,152	16,057	56,696	26,654
20	資金流入合計額	369,630	198,588	380,200	209,921
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	1,101,210		1,113,303	
22	純資金流出額	911,625		844,898	
23	単体流動性カバレッジ比率	120.7%		131.7%	
24	平均値計算用データ数	59		62	