

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		2019年3月期		2018年12月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,133,366		1,086,746	
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	4,784,453	405,151	4,750,796	402,885
3	うち、安定預金の額	1,055,014	31,650	1,039,609	31,188
4	うち、準安定預金の額	3,729,439	373,501	3,711,186	371,697
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,578,359	649,258	1,502,568	572,930
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	1,478,012	548,911	1,431,017	501,378
8	うち、負債性有価証券の額	100,346	100,346	71,551	71,551
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	8,832		9,845	
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	103,546	23,720	109,659	27,850
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	10,579	10,579	14,467	14,467
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	92,967	13,141	95,192	13,383
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	28,063	25,432	29,626	26,891
15	偶発事象に係る資金流出額	1,235,320	29,952	1,236,300	29,080
16	資金流出合計額	1,142,349		1,069,484	
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	307,832	172,097	289,920	168,127
19	その他資金流入額	21,518	11,178	44,364	31,701
20	資金流入合計額	329,350	183,275	334,284	199,829
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	1,133,366		1,086,746	
22	純資金流出額	959,074		869,654	
23	連結流動性カバレッジ比率	118.1%		124.9%	
24	平均値計算用データ数	58		62	

2. 単体流動性カバレッジ比率

(単位：百万円、%、件)

項 目		2019年3月期		2018年12月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,133,366		1,086,746	
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	4,784,453	405,151	4,750,796	402,885
3	うち、安定預金の額	1,055,014	31,650	1,039,609	31,188
4	うち、準安定預金の額	3,729,439	373,501	3,711,186	371,697
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,587,566	658,465	1,511,348	581,710
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	1,485,031	555,931	1,437,930	508,292
8	うち、負債性有価証券の額	102,534	102,534	73,417	73,417
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	8,832		9,845	
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	103,546	23,720	109,659	27,850
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	10,579	10,579	14,467	14,467
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	92,967	13,141	95,192	13,383
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	5,560	2,929	7,527	4,792
15	偶発事象に係る資金流出額	1,238,902	29,952	1,239,636	29,080
16	資金流出合計額	1,129,053		1,056,165	
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	317,028	181,292	295,957	174,165
19	その他資金流入額	21,542	11,202	44,390	31,727
20	資金流入合計額	338,570	192,494	340,347	205,893
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	1,133,366		1,086,746	
22	純資金流出額	936,559		850,272	
23	単体流動性カバレッジ比率	121.0%		127.8%	
24	平均値計算用データ数	58		62	