

連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項
(2019年6月期)

(別紙様式第二号)

(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	1,197,115		1,133,366	
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	4,794,851	406,348	4,784,453	405,151
3	うち、安定預金の額	1,052,598	31,577	1,055,014	31,650
4	うち、準安定預金の額	3,742,252	374,770	3,729,439	373,501
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,600,786	617,412	1,578,359	649,258
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	1,533,588	550,214	1,478,012	548,911
8	うち、負債性有価証券の額	67,197	67,197	100,346	100,346
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	15,008		8,832	
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	98,816	19,414	103,546	23,720
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	6,257	6,257	10,579	10,579
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	92,559	13,157	92,967	13,141
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	30,532	27,545	28,063	25,432
15	偶発事象に係る資金流出額	1,237,047	31,918	1,235,320	29,952
16	資金流出合計額	1,117,649		1,142,349	
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	282,950	159,828	307,832	172,097
19	その他資金流入額	30,290	20,459	21,518	11,178
20	資金流入合計額	313,240	180,287	329,350	183,275
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	1,197,115		1,133,366	
22	純資金流出額	937,361		959,074	
23	連結流動性カバレッジ比率	127.7%		118.1%	
24	平均値計算用データ数	59		58	