

単体流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（30年3月期）

（27年2月27日金融庁告示7号 別紙様式第一号）

（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	1,569,077		1,534,281	
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	4,908,751	379,399	4,852,159	376,440
3	うち、安定預金の額	1,666,661	49,999	1,627,471	48,824
4	うち、準安定預金の額	3,241,415	329,399	3,224,077	327,616
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,450,446	695,035	1,380,852	634,630
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	1,227,734	472,324	1,182,681	436,459
8	うち、負債性有価証券の額	222,711	222,711	198,170	198,170
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		4,823		7,458
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	2,064,999	377,789	2,043,442	363,469
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	159,935	159,935	145,886	145,886
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	1,905,064	217,854	1,897,555	217,582
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	16,536	10,179	23,006	16,220
15	偶発事象に係る資金流出額	33,477	669	33,602	672
16	資金流出合計額		1,467,896		1,398,891
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	624,656	391,112	623,575	402,627
19	その他資金流入額	339,545	269,447	283,690	224,636
20	資金流入合計額	964,202	660,559	907,265	627,263
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		1,569,077		1,534,281
22	純資金流出額		807,337		771,627
23	単体流動性カバレッジ比率		194.3%		198.8%
24	平均値計算用データ数		59		62

(27年2月27日金融庁告示7号 別紙様式第四号)

(単位：百万円、%)

KM1：主要な指標（銀行単体）						
国際様式の該当番号（注）		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		当四半期	前四半期	前々四半期	八の前四半期	二の前四半期
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	1,569,077	1,534,281	1,603,210	1,620,772	1,528,105
16	純資金流出額	807,337	771,627	798,382	876,510	797,318
17	単体流動性カバレッジ比率	194.3	198.8	200.8	184.9	191.6

（注）「国際様式の該当番号」とは、バーゼル銀行監督委員会により平成29年3月に公表された「開示要件（第3の柱）の統合及び強化 - 第2フェーズ」と題する最終規則文書における開示様式に記載された項目番号です。

連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（30年3月期）

（27年2月27日金融庁告示7号 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	1,569,077		1,534,281	
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	4,908,748	379,398	4,852,155	376,439
3	うち、安定預金の額	1,666,661	49,999	1,627,471	48,824
4	うち、準安定預金の額	3,241,412	329,399	3,224,073	327,615
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,438,463	683,053	1,368,928	622,706
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	1,217,582	462,172	1,172,664	426,442
8	うち、負債性有価証券の額	220,881	220,881	196,264	196,264
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		4,823		7,458
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	2,032,464	364,775	2,013,464	351,478
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	159,935	159,935	145,886	145,886
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	1,872,529	204,840	1,867,577	205,591
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	51,360	45,003	53,956	47,171
15	偶発事象に係る資金流出額	33,477	669	33,602	672
16	資金流出合計額		1,477,724		1,405,926
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	605,594	372,291	592,101	371,395
19	その他資金流入額	339,532	269,434	283,676	224,622
20	資金流入合計額	945,127	641,726	875,778	596,018
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		1,569,077		1,534,281
22	純資金流出額		835,997		809,908
23	連結流動性カバレッジ比率		187.6%		189.4%
24	平均値計算用データ数		59		62

(27年2月27日金融庁告示7号 別紙様式第五号)

(単位：百万円、%)

KM1：主要な指標（銀行連結・持株）						
国際様式の該当番号（注）		イ	ロ	ハ	ニ	ホ
		当四半期	前四半期	前々四半期	八の前四半期	二の前四半期
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	1,569,077	1,534,281	1,603,210	1,620,772	1,528,105
16	純資金流出額	835,997	809,908	836,196	911,818	836,403
17	連結流動性カバレッジ比率	187.6	189.4	191.7	177.7	182.6

（注）「国際様式の該当番号」とは、バーゼル銀行監督委員会により平成29年3月に公表された「開示要件（第3の柱）の統合及び強化 - 第2フェーズ」と題する最終規則文書における開示様式に記載された項目番号です。