

単体流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（2018年9月期）

（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	1,788,202		1,700,504	
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	4,956,479	382,807	4,891,056	379,384
3	うち、安定預金の額	1,683,908	50,517	1,640,798	49,223
4	うち、準安定預金の額	3,271,858	332,290	3,249,635	330,160
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,642,978	864,501	1,545,050	715,514
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	1,469,508	691,031	1,322,918	493,382
8	うち、負債性有価証券の額	173,470	173,470	222,131	222,131
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		1,901		3,107
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	2,049,949	367,275	2,096,595	381,187
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	143,920	143,920	152,816	152,816
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	1,906,028	223,354	1,943,778	228,371
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	20,465	7,854	23,660	15,298
15	偶発事象に係る資金流出額	32,377	647	33,144	662
16	資金流出合計額		1,624,988		1,495,154
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	589,813	361,157	575,442	358,736
19	その他資金流入額	274,364	223,038	313,771	240,521
20	資金流入合計額	864,178	584,196	889,214	599,257
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		1,788,202		1,700,504
22	純資金流出額		1,040,791		895,897
23	単体流動性カバレッジ比率		171.8		189.8
24	平均値計算用データ数		62		62

(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	ハの前四半期	ニの前四半期
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	1,788,202	1,700,504	1,569,077	1,534,281	1,603,210
16	純資金流出額	1,040,791	895,897	807,337	771,627	798,382
17	単体流動性カバレッジ比率	171.8	189.8	194.3	198.8	200.8

(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）の統合及び強化ー第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（2018年9月期）

（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	1,788,202		1,700,504	
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	4,956,476	382,807	4,891,052	379,384
3	うち、安定預金の額	1,683,908	50,517	1,640,798	49,223
4	うち、準安定預金の額	3,271,855	332,290	3,249,632	330,160
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,632,472	853,995	1,535,351	705,815
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	1,460,914	682,437	1,313,793	484,257
8	うち、負債性有価証券の額	171,558	171,558	221,558	221,558
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		1,901		3,107
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	2,015,658	353,559	2,062,641	367,606
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	143,920	143,920	152,816	152,816
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	1,871,737	209,638	1,909,825	214,790
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	50,470	37,859	56,698	48,336
15	偶発事象に係る資金流出額	32,377	647	33,144	662
16	資金流出合計額		1,630,769		1,504,913
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	576,607	348,180	558,326	341,866
19	その他資金流入額	274,352	223,027	313,760	240,509
20	資金流入合計額	850,960	571,208	872,086	582,375
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		1,788,202		1,700,504
22	純資金流出額		1,059,561		922,537
23	連結流動性カバレッジ比率		168.7		184.3
24	平均値計算用データ数		62		62

(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	ハの前四半期	ニの前四半期
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	1,788,202	1,700,504	1,569,077	1,534,281	1,603,210
16	純資金流出額	1,059,561	922,537	835,997	809,908	836,196
17	連結流動性カバレッジ比率	168.7	184.3	187.6	189.4	191.7

(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）の統合及び強化ー第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。