

〈流動性カバレッジ比率に関する開示事項〉(平成29年3月期 決算)

1. 連結流動性カバレッジ比率

(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	738,750		801,677	
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	2,203,764	192,909	2,439,486	192,621
3	うち、安定預金の額	656,682	22,780	743,444	22,303
4	うち、準安定預金の額	1,547,081	170,128	1,696,041	170,318
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	821,368	476,054	809,341	465,122
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	778,608	433,294	751,286	407,067
8	うち、負債性有価証券の額	42,759	42,759	58,054	58,054
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		3,503		4,371
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	70,854	57,825	51,927	39,715
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	56,204	56,204	37,980	37,980
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	14,649	1,621	13,946	1,734
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	45,213	32,624	33,042	17,637
15	偶発事象に係る資金流出額	523,895	15,501	523,153	15,480
16	資金流出合計額		778,418		734,949
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	141,898	131,363	106,289	97,222
19	その他資金流入額	164,957	116,313	145,168	92,792
20	資金流入合計額		247,676		190,014
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		738,750		801,677
22	純資金流出額		530,742		544,935
23	連結流動性カバレッジ比率		139.1		147.1
24	平均値計算用データ数	61		3	

上記は、平成27年金融庁告示第7号の別紙様式第2号に基づく開示事項です。

流動性カバレッジ比率は、中小・地域金融機関向けの総合的な監督指針「II-2-6-2」に定める「近似LCR」をもとに簡便な計算を行い、開示しております。

2. 単体流動性カバレッジ比率

(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	738,849		801,677	
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	2,454,080	192,909	2,439,486	192,621
3	うち、安定預金の額	759,352	22,780	743,444	22,303
4	うち、準安定預金の額	1,694,727	170,128	1,696,041	170,318
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	823,339	478,024	810,825	466,606
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	780,579	435,265	752,770	408,552
8	うち、負債性有価証券の額	42,759	42,759	58,054	58,054
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		3,503		4,371
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	69,041	57,825	51,927	39,715
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	56,204	56,204	37,980	37,980
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	12,837	1,621	13,946	1,734
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	45,213	31,283	31,278	16,972
15	偶発事象に係る資金流出額	501,533	14,855	500,894	14,836
16	資金流出合計額		778,401		735,124
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	139,240	130,339	102,484	95,040
19	その他資金流入額	164,965	116,305	145,176	92,800
20	資金流入合計額		246,644		187,840
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		738,849		801,677
22	純資金流出額		531,757		547,284
23	単体流動性カバレッジ比率		138.9		146.4
24	平均値計算用データ数	61		3	

上記は、平成27年金融庁告示第7号の別紙様式第1号に基づく開示事項です。

流動性カバレッジ比率は、中小・地域金融機関向けの総合的な監督指針「II-2-6-2」に定める「近似LCR」をもとに簡便な計算を行い、開示しております。