

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（2020年3月期 第1四半期）

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	適格流動資産の合計額	1,047,117		998,088	
資金流出額		資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額	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	3,612,706	282,006	3,595,761	280,217
3	うち、安定預金の額	1,147,972	34,439	1,149,100	34,473
4	うち、準安定預金の額	2,464,733	247,567	2,446,661	245,744
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	984,088	424,119	951,910	439,583
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	952,931	392,962	928,125	415,797
8	うち、負債性有価証券の額	31,156	31,156	23,785	23,785
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		2,084		933
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	1,636,703	171,273	1,606,090	163,137
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	38,586	38,586	34,159	34,159
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	1,598,117	132,687	1,571,931	128,978
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	45,978	31,966	34,618	29,373
15	偶発事象に係る資金流出額	31,766	6,027	31,728	5,916
16	資金流出合計額		917,477		919,161
資金流入額		資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額	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	296,394	164,088	323,432	176,996
19	その他資金流入額	64,848	55,460	52,235	40,633
20	資金流入合計額	361,243	219,549	375,667	217,629
連結流動性カバレッジ比率					
21	算入可能適格流動資産の合計額		1,047,117		998,088
22	純資金流出額		697,927		701,532
23	連結流動性カバレッジ比率		150.0		142.2
24	平均値計算用データ数		59		58

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	適格流動資産の合計額	1,047,117		998,088	
資金流出額		資金流出率 を乗じる前 の額	資金流出率 を乗じた後 の額	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	3,612,706	282,006	3,595,761	280,217
3	うち、安定預金の額	1,147,972	34,439	1,149,100	34,473
4	うち、準安定預金の額	2,464,733	247,567	2,446,661	245,744
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	988,704	428,735	958,185	445,858
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	956,700	396,731	932,884	420,556
8	うち、負債性有価証券の額	32,003	32,003	25,301	25,301
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		2,084		933
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	1,621,184	173,437	1,590,202	165,281
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	38,586	38,586	34,159	34,159
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	1,582,598	134,851	1,556,043	131,121
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	23,933	9,921	12,489	7,245
15	偶発事象に係る資金流出額	31,754	6,016	31,714	5,902
16	資金流出合計額		902,201		905,437
資金流入額		資金流入率 を乗じる前 の額	資金流入率 を乗じた後 の額	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	303,979	171,673	332,086	185,650
19	その他資金流入額	64,848	55,460	52,239	40,637
20	資金流入合計額	368,828	227,134	384,325	226,287
単体流動性カバレッジ比率					
21	算入可能適格流動資産の合計額		1,047,117		998,088
22	純資金流出額		675,066		679,150
23	単体流動性カバレッジ比率		155.1		146.9
24	平均値計算用データ数		59		58