

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 中間期）

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	1,074,690		1,047,117	
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	3,647,951	283,485	3,612,706	282,006
3	うち、安定預金の額	1,178,265	35,347	1,147,972	34,439
4	うち、準安定預金の額	2,469,686	248,137	2,464,733	247,567
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	959,564	414,939	984,088	424,119
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	939,258	394,634	952,931	392,962
8	うち、負債性有価証券の額	20,305	20,305	31,156	31,156
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		2,434		2,084
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	1,622,797	163,607	1,636,703	171,273
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	30,679	30,679	38,586	38,586
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	1,592,118	132,928	1,598,117	132,687
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	31,111	27,288	45,978	31,966
15	偶発事象に係る資金流出額	34,045	6,207	31,766	6,027
16	資金流出合計額		897,963		917,477
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	318,249	175,681	296,394	164,088
19	その他資金流入額	54,749	44,021	64,848	55,460
20	資金流入合計額	372,998	219,703	361,243	219,549
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		1,074,690		1,047,117
22	純資金流出額		678,259		697,927
23	連結流動性カバレッジ比率		158.4		150.0
24	平均値計算用データ数		62		59

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	1,074,690		1,047,117	
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	3,648,038	283,494	3,612,706	282,006
3	うち、安定預金の額	1,178,267	35,348	1,147,972	34,439
4	うち、準安定預金の額	2,469,771	248,146	2,464,733	247,567
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	965,164	420,540	988,704	428,735
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	943,611	398,986	956,700	396,731
8	うち、負債性有価証券の額	21,553	21,553	32,003	32,003
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		2,434		2,084
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	1,607,577	165,778	1,621,184	173,437
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	30,679	30,679	38,586	38,586
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	1,576,898	135,098	1,582,598	134,851
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	10,114	6,292	23,933	9,921
15	偶発事象に係る資金流出額	34,035	6,197	31,754	6,016
16	資金流出合計額		884,736		902,201
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	327,151	184,584	303,979	171,673
19	その他資金流入額	54,753	44,026	64,848	55,460
20	資金流入合計額	381,905	228,610	368,828	227,134
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		1,074,690		1,047,117
22	純資金流出額		656,125		675,066
23	単体流動性カバレッジ比率		163.7		155.1
24	平均値計算用データ数		62		59