

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3四半期）

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	1,044,751		1,074,690	
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	3,659,190	284,802	3,647,951	283,485
3	うち、安定預金の額	1,176,102	35,283	1,178,265	35,347
4	うち、準安定預金の額	2,483,088	249,519	2,469,686	248,137
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	942,665	402,530	959,564	414,939
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	917,485	377,350	939,258	394,634
8	うち、負債性有価証券の額	25,179	25,179	20,305	20,305
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		2,412		2,434
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	1,621,686	171,789	1,622,797	163,607
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	39,254	39,254	30,679	30,679
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	1,582,431	132,534	1,592,118	132,928
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	36,119	29,591	31,111	27,288
15	偶発事象に係る資金流出額	33,928	5,856	34,045	6,207
16	資金流出合計額		896,983		897,963
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	306,693	164,920	318,249	175,681
19	その他資金流入額	64,680	47,369	54,749	44,021
20	資金流入合計額	371,373	212,289	372,998	219,703
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		1,044,751		1,074,690
22	純資金流出額		684,693		678,259
23	連結流動性カバレッジ比率		152.5		158.4
24	平均値計算用データ数		62		62

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	1,044,751		1,074,690	
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	3,659,221	284,805	3,648,038	283,494
3	うち、安定預金の額	1,176,102	35,283	1,178,267	35,348
4	うち、準安定預金の額	2,483,119	249,522	2,469,771	248,146
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	948,174	408,038	965,164	420,540
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	922,339	382,204	943,611	398,986
8	うち、負債性有価証券の額	25,834	25,834	21,553	21,553
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		2,412		2,434
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	1,604,924	173,236	1,607,577	165,778
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	39,254	39,254	30,679	30,679
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	1,565,669	133,981	1,576,898	135,098
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	15,024	8,496	10,114	6,292
15	偶発事象に係る資金流出額	33,918	5,846	34,035	6,197
16	資金流出合計額		882,836		884,736
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	310,327	168,554	327,151	184,584
19	その他資金流入額	64,680	47,369	54,753	44,026
20	資金流入合計額	375,007	215,923	381,905	228,610
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		1,044,751		1,074,690
22	純資金流出額		666,913		656,125
23	単体流動性カバレッジ比率		156.6		163.7
24	平均値計算用データ数		62		62