

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）

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 | 1,073,388 | | 1,044,751 | |
| 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 | 3,696,051 | 286,129 | 3,659,190 | 284,802 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 1,209,562 | 36,286 | 1,176,102 | 35,283 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 2,486,488 | 249,842 | 2,483,088 | 249,519 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 929,414 | 387,184 | 942,665 | 402,530 |
| 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 | 904,448 | 362,219 | 917,485 | 377,350 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 24,965 | 24,965 | 25,179 | 25,179 |
| 9 | 有担保資金調達等に係る資金流出額 | | 6,055 | | 2,412 |
| 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 | 1,616,967 | 166,889 | 1,621,686 | 171,789 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 36,052 | 36,052 | 39,254 | 39,254 |
| 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 | 1,580,914 | 130,837 | 1,582,431 | 132,534 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 35,254 | 29,756 | 36,119 | 29,591 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 34,263 | 6,269 | 33,928 | 5,856 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 882,284 | | 896,983 |
| 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 | 322,116 | 174,033 | 306,693 | 164,920 |
| 19 | その他資金流入額 | 66,480 | 49,988 | 64,680 | 47,369 |
| 20 | 資金流入合計額 | 388,596 | 224,022 | 371,373 | 212,289 |
| 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 | | 1,073,388 | | 1,044,751 |
| 22 | 純資金流出額 | | 658,262 | | 684,693 |
| 23 | 連結流動性カバレッジ比率 | | 163.0 | | 152.5 |
| 24 | 平均値計算用データ数 | | 58 | | 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 | 1,073,388 | | 1,044,751 | |
| 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 | 3,696,142 | 286,138 | 3,659,221 | 284,805 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 1,209,564 | 36,286 | 1,176,102 | 35,283 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 2,486,578 | 249,851 | 2,483,119 | 249,522 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 934,642 | 392,412 | 948,174 | 408,038 |
| 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 | 908,067 | 365,838 | 922,339 | 382,204 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 26,574 | 26,574 | 25,834 | 25,834 |
| 9 | 有担保資金調達等に係る資金流出額 | | 6,055 | | 2,412 |
| 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 | 1,602,777 | 169,262 | 1,604,924 | 173,236 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 36,052 | 36,052 | 39,254 | 39,254 |
| 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 | 1,566,725 | 133,209 | 1,565,669 | 133,981 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 14,082 | 8,584 | 15,024 | 8,496 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 34,253 | 6,259 | 33,918 | 5,846 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 868,712 | | 882,836 |
| 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 | 326,543 | 178,461 | 310,327 | 168,554 |
| 19 | その他資金流入額 | 66,484 | 49,992 | 64,680 | 47,369 |
| 20 | 資金流入合計額 | 393,028 | 228,453 | 375,007 | 215,923 |
| 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 | | 1,073,388 | | 1,044,751 |
| 22 | 純資金流出額 | | 640,258 | | 666,913 |
| 23 | 単体流動性カバレッジ比率 | | 167.6 | | 156.6 |
| 24 | 平均値計算用データ数 | | 58 | | 62 |