

### Ⅲ. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項【連結・単体共通】

#### 1. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項【連結】

(単位：百万円、%、件)

項目		2019年度第4四半期 (2020年1月1日から2020年3月31日まで)		2019年度第3四半期 (2019年10月1日から2019年12月31日まで)	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,511,713		1,517,034	
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	5,152,087	410,117	5,097,516	407,116
3	うち、安定預金の額	1,675,699	50,270	1,642,356	49,270
4	うち、準安定預金の額	3,476,388	359,846	3,455,159	357,846
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,582,437	717,686	1,553,957	683,241
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	1,457,422	592,671	1,419,398	548,682
8	うち、負債性有価証券の額	125,015	125,015	134,559	134,559
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	—	28,435	—	11,351
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	1,582,030	214,160	1,632,791	241,527
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	85,667	85,667	110,144	110,144
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	1,496,363	128,492	1,522,647	131,382
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	54,661	47,965	62,781	53,828
15	偶発事象に係る資金流出額	46,969	13,349	48,077	13,568
16	資金流出合計額	—	1,431,713	—	1,410,633
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	574,716	399,439	539,917	385,036
19	その他資金流入額	154,460	117,773	168,471	140,185
20	資金流入合計額	729,176	517,212	708,388	525,222
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	—	1,511,713	—	1,517,034
22	純資金流出額	—	914,501	—	885,411
23	連結流動性カバレッジ比率	—	165.3	—	171.3
24	平均値計算用データ数	58		62	

2. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項【単体】

(単位：百万円、%、件)

項目		2019年度第4四半期 (2020年1月1日から2020年3月31日まで)		2019年度第3四半期 (2019年10月1日から2019年12月31日まで)	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,511,713		1,517,034	
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	5,152,087	410,117	5,097,516	407,116
3	うち、安定預金の額	1,675,699	50,270	1,642,356	49,270
4	うち、準安定預金の額	3,476,388	359,846	3,455,159	357,846
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,592,585	727,834	1,563,227	692,511
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	1,466,367	601,616	1,427,865	557,149
8	うち、負債性有価証券の額	126,217	126,217	135,362	135,362
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	—	28,435	—	11,351
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	1,588,600	216,260	1,639,852	243,734
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	85,667	85,667	110,145	110,145
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	1,502,933	130,593	1,529,706	133,588
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	30,276	23,580	40,333	31,381
15	偶発事象に係る資金流出額	46,969	13,349	48,077	13,568
16	資金流出合計額	—	1,419,577	—	1,399,663
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	575,323	399,837	540,137	385,146
19	その他資金流入額	154,464	117,777	168,476	140,190
20	資金流入合計額	729,787	517,615	708,613	525,336
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	—	1,511,713	—	1,517,034
22	純資金流出額	—	901,962	—	874,327
23	単体流動性カバレッジ比率	—	167.6	—	173.5
24	平均値計算用データ数	58		62	