

「流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項」

[連結]2020年3月期 第4四半期(別紙様式第二号)

(単位:百万円、%、件)

項目		当四半期		前四半期	
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	

「流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項」

[単体]2020年3月期 第4四半期(別紙様式第一号)

(単位:百万円、%、件)

項目		当四半期		前四半期	
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	