

「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6月期(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	1,582,766		1,511,713	
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	5,223,793	414,019	5,152,087	410,117
3	うち、安定預金の額	1,727,419	51,822	1,675,699	50,270
4	うち、準安定預金の額	3,496,373	362,197	3,476,388	359,846
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,787,203	749,088	1,582,437	717,686
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	1,662,338	624,223	1,457,422	592,671
8	うち、負債性有価証券の額	124,864	124,864	125,015	125,015
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		9,613		28,435
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	1,614,764	203,469	1,582,030	214,160
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	72,610	72,610	85,667	85,667
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	1,542,153	130,859	1,496,363	128,492
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	66,403	52,379	54,661	47,965
15	偶発事象に係る資金流出額	45,445	12,562	46,969	13,349
16	資金流出合計額		1,441,134		1,431,713
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	549,579	384,883	574,716	399,439
19	その他資金流入額	115,802	87,565	154,460	117,773
20	資金流入合計額	665,382	472,449	729,176	517,212
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		1,582,766		1,511,713
22	純資金流出額		968,684		914,501
23	連結流動性カバレッジ比率		163.3		165.3
24	平均値計算用データ数	61		58	

「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6月期(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	1,582,766		1,511,713	
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	5,223,793	414,019	5,152,087	410,117
3	うち、安定預金の額	1,727,419	51,822	1,675,699	50,270
4	うち、準安定預金の額	3,496,373	362,197	3,476,388	359,846
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,796,984	758,869	1,592,585	727,834
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	1,671,316	633,202	1,466,367	601,616
8	うち、負債性有価証券の額	125,667	125,667	126,217	126,217
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		9,613		28,435
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	1,621,510	205,649	1,588,600	216,260
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	72,616	72,616	85,667	85,667
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	1,548,894	133,033	1,502,933	130,593
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	41,067	27,043	30,276	23,580
15	偶発事象に係る資金流出額	45,445	12,562	46,969	13,349
16	資金流出合計額		1,427,758		1,419,577
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	549,941	385,064	575,323	399,837
19	その他資金流入額	115,812	87,575	154,464	117,777
20	資金流入合計額	665,753	472,640	729,787	517,615
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		1,582,766		1,511,713
22	純資金流出額		955,118		901,962
23	単体流動性カバレッジ比率		165.7		167.6
24	平均値計算用データ数	61		58	