

「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9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 | 1,757,712 | | 1,582,766 | |
| 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 | 5,403,680 | 421,922 | 5,223,793 | 414,019 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 1,881,984 | 56,459 | 1,727,419 | 51,822 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 3,521,696 | 365,462 | 3,496,373 | 362,197 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 1,886,472 | 821,293 | 1,787,203 | 749,088 |
| 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 | 1,767,153 | 701,974 | 1,662,338 | 624,223 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 119,319 | 119,319 | 124,864 | 124,864 |
| 9 | 有担保資金調達等に係る資金流出額 | | 10,149 | | 9,613 |
| 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 | 1,706,372 | 237,171 | 1,614,764 | 203,469 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 98,960 | 98,960 | 72,610 | 72,610 |
| 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 | 1,607,411 | 138,210 | 1,542,153 | 130,859 |
| 14 | 資金提供義務等に基づく資金流出額等 | 59,632 | 55,248 | 66,403 | 52,379 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 44,460 | 11,461 | 45,445 | 12,562 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 1,557,246 | | 1,441,134 |
| 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 | 648,072 | 491,276 | 549,579 | 384,883 |
| 19 | その他資金流入額 | 151,850 | 121,480 | 115,802 | 87,565 |
| 20 | 資金流入合計額 | 799,922 | 612,756 | 665,382 | 472,449 |
| 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 | | 1,757,712 | | 1,582,766 |
| 22 | 純資金流出額 | | 944,489 | | 968,684 |
| 23 | 連結流動性カバレッジ比率 | | 186.1 | | 163.3 |
| 24 | 平均値計算用データ数 | 61 | | 61 | |

「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9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 | 1,757,712 | | 1,582,766 | |
| 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 | 5,403,680 | 421,922 | 5,223,793 | 414,019 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 1,881,984 | 56,459 | 1,727,419 | 51,822 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 3,521,696 | 365,462 | 3,496,373 | 362,197 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 1,895,597 | 830,418 | 1,796,984 | 758,869 |
| 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 | 1,775,343 | 710,164 | 1,671,316 | 633,202 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 120,253 | 120,253 | 125,667 | 125,667 |
| 9 | 有担保資金調達等に係る資金流出額 | | 10,149 | | 9,613 |
| 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 | 1,713,131 | 239,354 | 1,621,510 | 205,649 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 98,969 | 98,969 | 72,616 | 72,616 |
| 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 | 1,614,162 | 140,385 | 1,548,894 | 133,033 |
| 14 | 資金提供義務等に基づく資金流出額等 | 34,516 | 30,133 | 41,067 | 27,043 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 44,460 | 11,461 | 45,445 | 12,562 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 1,543,438 | | 1,427,758 |
| 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 | 648,470 | 491,475 | 549,941 | 385,064 |
| 19 | その他資金流入額 | 151,863 | 121,493 | 115,812 | 87,575 |
| 20 | 資金流入合計額 | 800,334 | 612,969 | 665,753 | 472,640 |
| 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 | | 1,757,712 | | 1,582,766 |
| 22 | 純資金流出額 | | 930,469 | | 955,118 |
| 23 | 単体流動性カバレッジ比率 | | 188.9 | | 165.7 |
| 24 | 平均値計算用データ数 | 61 | | 61 | |