

「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12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	1,776,328		1,757,712	
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	5,438,256	425,641	5,403,680	421,922
3	うち、安定預金の額	1,882,538	56,476	1,881,984	56,459
4	うち、準安定預金の額	3,555,717	369,165	3,521,696	365,462
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,943,035	864,634	1,886,472	821,293
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	1,808,000	729,600	1,767,153	701,974
8	うち、負債性有価証券の額	135,034	135,034	119,319	119,319
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		14,032		10,149
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	1,675,310	200,375	1,706,372	237,171
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	59,849	59,849	98,960	98,960
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	1,615,460	140,526	1,607,411	138,210
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	75,901	69,183	59,632	55,248
15	偶発事象に係る資金流出額	42,613	10,665	44,460	11,461
16	資金流出合計額		1,584,533		1,557,246
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	759,267	606,682	648,072	491,276
19	その他資金流入額	116,594	91,918	151,850	121,480
20	資金流入合計額	875,861	698,600	799,922	612,756
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		1,776,328		1,757,712
22	純資金流出額		885,932		944,489
23	連結流動性カバレッジ比率		200.5		186.1
24	平均値計算用データ数	63		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12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	1,776,328		1,757,712	
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	5,438,256	425,641	5,403,680	421,922
3	うち、安定預金の額	1,882,538	56,476	1,881,984	56,459
4	うち、準安定預金の額	3,555,717	369,165	3,521,696	365,462
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,952,700	874,299	1,895,597	830,418
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	1,816,886	738,485	1,775,343	710,164
8	うち、負債性有価証券の額	135,814	135,814	120,253	120,253
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		14,032		10,149
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	1,681,984	202,509	1,713,131	239,354
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	59,852	59,852	98,969	98,969
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	1,622,132	142,657	1,614,162	140,385
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	50,415	43,698	34,516	30,133
15	偶発事象に係る資金流出額	42,613	10,665	44,460	11,461
16	資金流出合計額		1,570,846		1,543,438
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	759,814	607,015	648,470	491,475
19	その他資金流入額	116,601	91,924	151,863	121,493
20	資金流入合計額	876,415	698,940	800,334	612,969
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		1,776,328		1,757,712
22	純資金流出額		871,906		930,469
23	単体流動性カバレッジ比率		203.7		188.9
24	平均値計算用データ数	63		61	