

〈流動性カバレッジ比率に関する開示事項〉(2020年6月期 決算)

1. 連結流動性カバレッジ比率

(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	1,039,523		930,106	
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	2,727,632	209,178	2,681,409	206,244
3	うち、安定預金の額	918,289	27,550	894,034	26,823
4	うち、準安定預金の額	1,809,343	181,581	1,787,375	179,387
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,558,107	979,040	1,648,730	1,181,848
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	1,487,745	908,678	1,580,005	1,113,123
8	うち、負債性有価証券の額	70,362	70,362	68,725	68,725
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		26,489		19,603
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	73,147	58,029	55,736	41,748
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	56,155	56,155	39,864	39,864
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	16,991	1,873	15,872	1,884
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	75,796	47,365	86,063	64,612
15	偶発事象に係る資金流出額	574,142	17,036	575,970	17,079
16	資金流出合計額		1,337,140		1,531,137
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	701,515	623,881	845,328	780,839
19	その他資金流入額	93,766	84,975	120,686	111,475
20	資金流入合計額	795,282	708,856	966,014	892,314
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		1,039,523		930,106
22	純資金流出額		628,283		639,641
23	連結流動性カバレッジ比率		165.4		145.4
24	平均値計算用データ数	61		58	

上記は、平成27年金融庁告示第7号の別紙様式第2号に基づく開示事項です。

2. 単体流動性カバレッジ比率

(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	1,039,523		930,106	
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	2,727,632	209,178	2,681,409	206,244
3	うち、安定預金の額	918,289	27,550	894,034	26,823
4	うち、準安定預金の額	1,809,343	181,581	1,787,375	179,387
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,560,838	981,770	1,651,170	1,184,288
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	1,490,475	911,408	1,582,444	1,115,563
8	うち、負債性有価証券の額	70,362	70,362	68,725	68,725
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		26,489		19,603
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	73,147	58,029	55,736	41,748
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	56,155	56,155	39,864	39,864
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	16,991	1,873	15,872	1,884
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	74,521	46,090	84,425	62,974
15	偶発事象に係る資金流出額	559,491	16,585	561,084	16,619
16	資金流出合計額		1,338,143		1,531,478
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	702,642	626,387	845,282	782,350
19	その他資金流入額	93,776	84,984	120,695	111,484
20	資金流入合計額	796,419	711,371	965,978	893,834
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		1,039,523		930,106
22	純資金流出額		626,772		638,485
23	単体流動性カバレッジ比率		165.8		145.6
24	平均値計算用データ数	61		58	

上記は、平成27年金融庁告示第7号の別紙様式第1号に基づく開示事項です。