

〈流動性カバレッジ比率に関する開示事項〉(2020年12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	1,081,685		1,107,639	
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	2,862,247	217,274	2,831,953	214,965
3	うち、安定預金の額	994,916	29,850	984,546	29,539
4	うち、準安定預金の額	1,867,331	187,389	1,847,406	185,389
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,567,825	1,018,609	1,541,775	990,925
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	1,503,051	953,835	1,444,771	893,922
8	うち、負債性有価証券の額	64,774	64,774	97,003	97,003
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		77,238		43,636
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	58,010	40,534	60,654	45,311
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	38,307	38,307	43,437	43,437
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	19,703	2,227	17,217	1,874
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	91,505	74,520	71,895	51,934
15	偶発事象に係る資金流出額	575,696	17,084	578,896	17,182
16	資金流出合計額		1,445,262		1,363,956
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	89,523	89,523	43,770	43,770
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	766,476	698,535	670,986	607,550
19	その他資金流入額	107,929	95,517	103,898	92,202
20	資金流入合計額	963,929	883,576	818,655	743,524
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		1,081,685		1,107,639
22	純資金流出額		562,187		620,432
23	連結流動性カバレッジ比率		192.4		178.5
24	平均値計算用データ数	63		61	

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	1,081,685		1,107,639	
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	2,862,247	217,274	2,831,953	214,965
3	うち、安定預金の額	994,916	29,850	984,546	29,539
4	うち、準安定預金の額	1,867,331	187,389	1,847,406	185,389
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,571,542	1,022,326	1,544,349	993,499
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	1,506,768	957,552	1,447,345	896,496
8	うち、負債性有価証券の額	64,774	64,774	97,003	97,003
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		77,238		43,636
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	58,010	40,534	60,654	45,311
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	38,307	38,307	43,437	43,437
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	19,703	2,227	17,217	1,874
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	90,415	73,430	70,807	50,846
15	偶発事象に係る資金流出額	561,312	16,641	564,521	16,739
16	資金流出合計額		1,447,446		1,364,999
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	89,523	89,523	43,770	43,770
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	767,454	700,820	671,634	609,522
19	その他資金流入額	107,938	95,527	103,908	92,212
20	資金流入合計額	964,916	885,870	819,313	745,504
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		1,081,685		1,107,639
22	純資金流出額		562,145		619,494
23	単体流動性カバレッジ比率		192.4		178.7
24	平均値計算用データ数	63		61	

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。