

〈流動性カバレッジ比率に関する開示事項〉(2020年3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	930,106		977,556	
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	2,681,409	206,244	2,653,535	204,932
3	うち、安定預金の額	894,034	26,823	873,131	26,196
4	うち、準安定預金の額	1,787,375	179,387	1,780,403	178,708
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,648,730	1,181,848	1,633,168	1,172,759
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	1,580,005	1,113,123	1,548,763	1,088,354
8	うち、負債性有価証券の額	68,725	68,725	84,404	84,404
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	19,603		10,429	
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	55,736	41,748	55,412	41,591
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	39,864	39,864	39,675	39,675
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	15,872	1,884	15,737	1,916
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	86,063	64,612	69,835	48,636
15	偶発事象に係る資金流出額	575,970	17,079	575,701	17,070
16	資金流出合計額	1,531,137		1,495,420	
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	845,328	780,839	788,565	732,582
19	その他資金流入額	120,686	111,475	93,873	84,787
20	資金流入合計額	966,014	892,314	882,439	817,369
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	930,106		977,556	
22	純資金流出額	639,641		679,587	
23	連結流動性カバレッジ比率	145.4		143.8	
24	平均値計算用データ数	58		62	

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	930,106		977,556	
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	2,681,409	206,244	2,653,535	204,932
3	うち、安定預金の額	894,034	26,823	873,131	26,196
4	うち、準安定預金の額	1,787,375	179,387	1,780,403	178,708
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,651,170	1,184,288	1,635,574	1,175,165
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	1,582,444	1,115,563	1,551,170	1,090,760
8	うち、負債性有価証券の額	68,725	68,725	84,404	84,404
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		19,603		10,429
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	55,736	41,748	55,412	41,591
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	39,864	39,864	39,675	39,675
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	15,872	1,884	15,737	1,916
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	84,425	62,974	68,076	46,877
15	偶発事象に係る資金流出額	561,084	16,619	560,878	16,616
16	資金流出合計額		1,531,478		1,495,613
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	845,282	782,350	788,804	734,405
19	その他資金流入額	120,695	111,484	93,882	84,795
20	資金流入合計額	965,978	893,834	882,687	819,201
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		930,106		977,556
22	純資金流出額		638,485		677,971
23	単体流動性カバレッジ比率		145.6		144.1
24	平均値計算用データ数	58		62	

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。