

〈流動性カバレッジ比率に関する開示事項〉(2020年9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	1,107,639		1,039,523	
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	2,831,953	214,965	2,727,632	209,178
3	うち、安定預金の額	984,546	29,539	918,289	27,550
4	うち、準安定預金の額	1,847,406	185,389	1,809,343	181,581
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,541,775	990,925	1,558,107	979,040
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	1,444,771	893,922	1,487,745	908,678
8	うち、負債性有価証券の額	97,003	97,003	70,362	70,362
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		43,636		26,489
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	60,654	45,311	73,147	58,029
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	43,437	43,437	56,155	56,155
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	17,217	1,874	16,991	1,873
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	71,895	51,934	75,796	47,365
15	偶発事象に係る資金流出額	578,896	17,182	574,142	17,036
16	資金流出合計額		1,363,956		1,337,140
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	43,770	43,770	-	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	670,986	607,550	701,515	623,881
19	その他資金流入額	103,898	92,202	93,766	84,975
20	資金流入合計額	818,655	743,524	795,282	708,856
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		1,107,639		1,039,523
22	純資金流出額		620,432		628,283
23	連結流動性カバレッジ比率		178.5		165.4
24	平均値計算用データ数	61		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	1,107,639		1,039,523	
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	2,831,953	214,965	2,727,632	209,178
3	うち、安定預金の額	984,546	29,539	918,289	27,550
4	うち、準安定預金の額	1,847,406	185,389	1,809,343	181,581
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,544,349	993,499	1,560,838	981,770
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	1,447,345	896,496	1,490,475	911,408
8	うち、負債性有価証券の額	97,003	97,003	70,362	70,362
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		43,636		26,489
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	60,654	45,311	73,147	58,029
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	43,437	43,437	56,155	56,155
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	17,217	1,874	16,991	1,873
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	70,807	50,846	74,521	46,090
15	偶発事象に係る資金流出額	564,521	16,739	559,491	16,585
16	資金流出合計額		1,364,999		1,338,143
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	43,770	43,770	-	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	671,634	609,522	702,642	626,387
19	その他資金流入額	103,908	92,212	93,776	84,984
20	資金流入合計額	819,313	745,504	796,419	711,371
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		1,107,639		1,039,523
22	純資金流出額		619,494		626,772
23	単体流動性カバレッジ比率		178.7		165.8
24	平均値計算用データ数	61		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。