

Ⅲ、流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

1. 連結流動性カバレッジ比率

(単位：百万円、%、件)

項 目		2020年3月期		2019年12月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,455,536		1,412,377	
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	4,930,684	416,499	4,877,340	412,298
3	うち、安定預金の額	1,101,292	33,038	1,085,207	32,556
4	うち、準安定預金の額	3,829,392	383,460	3,792,132	379,742
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,623,101	640,342	1,566,002	605,495
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	1,533,666	550,907	1,492,264	531,757
8	うち、負債性有価証券の額	89,434	89,434	73,738	73,738
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		19,264		21,491
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	97,877	21,787	98,870	22,271
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	10,707	10,707	9,405	9,405
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	87,170	11,080	89,465	12,866
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	32,638	27,620	30,149	24,840
15	偶発事象に係る資金流出額	1,221,963	34,156	1,224,606	33,905
16	資金流出合計額		1,159,670		1,120,304
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	290,588	160,542	286,927	167,223
19	その他資金流入額	31,087	17,968	36,873	24,663
20	資金流入合計額	321,675	178,511	323,800	191,887
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		1,455,536		1,412,377
22	純資金流出額		981,159		928,416
23	連結流動性カバレッジ比率		148.3%		152.1%
24	平均値計算用データ数		58		62

2. 単体流動性カバレッジ比率

(単位：百万円、%、件)

項 目		2020年3月期		2019年12月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,455,536		1,412,377	
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	4,930,684	416,499	4,877,340	412,298
3	うち、安定預金の額	1,101,292	33,038	1,085,207	32,556
4	うち、準安定預金の額	3,829,392	383,460	3,792,132	379,742
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,633,048	650,288	1,576,007	615,499
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	1,541,580	558,821	1,500,259	539,751
8	うち、負債性有価証券の額	91,467	91,467	75,747	75,747
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		19,264		21,491
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	98,059	21,835	98,870	22,271
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	10,707	10,707	9,405	9,405
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	87,352	11,128	89,465	12,866
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	9,226	4,208	7,781	2,472
15	偶発事象に係る資金流出額	1,228,250	34,156	1,227,659	33,905
16	資金流出合計額		1,146,253		1,107,940
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	305,091	175,045	302,795	183,092
19	その他資金流入額	31,108	17,990	36,900	24,690
20	資金流入合計額	336,199	193,036	339,695	207,782
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		1,455,536		1,412,377
22	純資金流出額		953,217		900,157
23	単体流動性カバレッジ比率		152.6%		156.9%
24	平均値計算用データ数		58		62