

単体流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項
(2020年3月期)

(別紙様式第一号)

(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	1,455,536		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	