

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6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	1,535,399		1,455,536	
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	4,991,474	421,009	4,930,684	416,499
3	うち、安定預金の額	1,123,661	33,709	1,101,292	33,038
4	うち、準安定預金の額	3,867,813	387,299	3,829,392	383,460
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,778,709	677,418	1,633,048	650,288
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	1,706,753	605,462	1,541,580	558,821
8	うち、負債性有価証券の額	71,956	71,956	91,467	91,467
9	有担保資金調達等に係る資金流出額			19,264	
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	96,704	20,491	98,059	21,835
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	9,333	9,333	10,707	10,707
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	87,371	11,158	87,352	11,128
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	11,267	5,300	9,226	4,208
15	偶発事象に係る資金流出額	1,220,051	34,238	1,228,250	34,156
16	資金流出合計額	1,183,769		1,146,253	
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	362,964	239,083	305,091	175,045
19	その他資金流入額	42,722	28,301	31,108	17,990
20	資金流入合計額	405,686	267,385	336,199	193,036
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	1,535,399		1,455,536	
22	純資金流出額	916,383		953,217	
23	単体流動性カバレッジ比率	167.5%		152.6%	
24	平均値計算用データ数	61		58	