

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12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	2,050,350		1,874,825	
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	5,192,868	436,362	5,164,577	433,625
3	うち、安定預金の額	1,191,972	35,759	1,190,626	35,718
4	うち、準安定預金の額	4,000,895	400,603	3,973,950	397,906
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,965,209	807,820	1,794,919	681,289
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	1,920,739	763,349	1,730,818	617,188
8	うち、負債性有価証券の額	44,470	44,470	64,100	64,100
9	有担保資金調達等に係る資金流出額				
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	120,404	25,362	109,025	22,306
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	12,070	12,070	9,997	9,997
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	108,334	13,292	99,028	12,309
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	11,106	2,846	7,375	2,374
15	偶発事象に係る資金流出額	1,201,672	33,461	1,234,143	34,901
16	資金流出合計額	1,330,421		1,201,015	
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	259,319	142,828	294,384	168,053
19	その他資金流入額	50,611	20,937	26,684	12,115
20	資金流入合計額	309,930	163,766	321,068	180,169
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	2,050,350		1,874,825	
22	純資金流出額	1,166,654		1,020,845	
23	単体流動性カバレッジ比率	175.7%		183.6%	
24	平均値計算用データ数	63		61	