

連結流動性カバレッジ比率に関する開示事項（2020年3月末）

（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	613,927		662,895	
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	2,654,626	215,699	2,627,099	214,250
3	うち、安定預金の額	723,348	21,700	705,460	21,163
4	うち、準安定預金の額	1,931,277	193,998	1,921,639	193,086
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	686,454	263,630	656,250	241,915
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	667,535	244,711	641,724	227,389
8	うち、負債性有価証券の額	18,919	18,919	14,525	14,525
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	784,918	76,762	786,568	72,513
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	20,503	20,503	15,867	15,867
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	764,414	56,258	770,700	56,646
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	35,204	32,419	37,050	30,634
15	偶発事象に係る資金流出額	7,097	667	6,940	568
16	資金流出合計額	589,178		559,883	
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	239,837	132,638	234,338	131,411
19	その他資金流入額	60,782	50,850	42,843	38,236
20	資金流入合計額	300,620	183,489	277,181	169,648
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	613,927		662,895	
22	純資金流出額	405,689		390,235	
23	連結流動性カバレッジ比率	151.3		169.8	
24	平均値計算用データ数	58		62	

単体流動性カバレッジ比率に関する開示事項（2020年3月末）

（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	613,927		662,895	
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	2,654,626	215,699	2,627,099	214,250
3	うち、安定預金の額	723,348	21,700	705,460	21,163
4	うち、準安定預金の額	1,931,277	193,998	1,921,639	193,086
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	694,731	271,906	664,093	249,757
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	675,812	252,987	649,567	235,231
8	うち、負債性有価証券の額	18,919	18,919	14,525	14,525
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	777,879	77,771	779,305	73,505
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	20,503	20,503	15,867	15,867
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	757,375	57,268	763,437	57,638
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	7,243	4,458	9,898	3,482
15	偶発事象に係る資金流出額	7,097	667	6,940	568
16	資金流出合計額	570,503		541,565	
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	246,933	139,734	241,309	138,383
19	その他資金流入額	60,785	50,853	42,845	38,238
20	資金流入合計額	307,718	190,587	284,154	176,621
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	613,927		662,895	
22	純資金流出額	379,916		364,943	
23	単体流動性カバレッジ比率	161.5		181.6	
24	平均値計算用データ数	58		62	