

連結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 第3四半期)

(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 | 2,120,256 | | 2,079,026 | |
| 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 | 2,676,200 | 258,452 | 2,680,678 | 258,806 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 149,275 | 4,478 | 149,821 | 4,494 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 2,526,925 | 253,974 | 2,530,857 | 254,311 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 2,599,480 | 1,044,340 | 2,571,509 | 1,047,600 |
| 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 | 2,466,399 | 911,260 | 2,418,585 | 894,675 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 133,080 | 133,080 | 152,924 | 152,924 |
| 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 | 446,862 | 61,020 | 454,565 | 66,437 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 35,334 | 35,334 | 40,619 | 40,619 |
| 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 | 411,527 | 25,685 | 413,945 | 25,818 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 136,932 | 25,094 | 130,574 | 23,587 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 1,451,538 | 58,407 | 1,436,732 | 57,938 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 1,447,315 | | 1,454,369 |
| 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 | 688,569 | 396,117 | 827,804 | 528,630 |
| 19 | その他資金流入額 | 64,346 | 27,990 | 83,628 | 35,113 |
| 20 | 資金流入合計額 | 752,916 | 424,108 | 911,432 | 563,743 |
| 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 | | 2,120,256 | | 2,079,026 |
| 22 | 純資金流出額 | | 1,023,207 | | 890,626 |
| 23 | 連結流動性カバレッジ比率 | | 207.2 | | 233.4 |
| 24 | 平均値計算用データ数 | 62 | | 62 | |