

<流動性規制に関する開示>

連結流動性カバレッジ比率に関する定量的事項(2020年3月期 第1四半期)

(単位:百万円、%、件)

項目		当四半期		前四半期	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	1,618,393		1,430,392	
<b>資金流出額 (2)</b>		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	3,685,934	294,217	3,670,761	292,781
3	うち、安定預金の額	1,068,559	32,056	1,067,690	32,030
4	うち、準安定預金の額	2,617,280	262,160	2,602,970	260,751
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,694,949	1,004,113	1,716,416	1,042,115
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	1,442,548	751,711	1,451,466	777,165
8	うち、負債性有価証券の額	252,401	252,401	264,950	264,950
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	1,441,109	309,822	1,401,828	300,639
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	192,898	192,898	187,373	187,373
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	1,248,211	116,924	1,214,454	113,265
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	5,108	3,749	2,628	954
15	偶発事象に係る資金流出額	39,395	9,287	43,470	9,190
16	資金流出合計額	1,621,191		1,645,681	
<b>資金流入額 (3)</b>		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	348,805	187,121	384,441	210,164
19	その他資金流入額	240,570	207,845	216,054	201,538
20	資金流入合計額	589,376	394,966	600,496	411,702
<b>連結流動性カバレッジ比率 (4)</b>					
21	算入可能適格流動資産の合計額	1,618,393		1,430,392	
22	純資金流出額	1,226,224		1,233,979	
23	連結流動性カバレッジ比率	131.9%		115.9%	
24	平均値計算用データ数	59件		58件	

<流動性規制に関する開示>

単体流動性カバレッジ比率に関する定量的事項(2020年3月期 第1四半期)

(単位:百万円、%、件)

項目		当四半期		前四半期	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	1,618,393		1,430,392	
<b>資金流出額 (2)</b>		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	3,685,934	294,217	3,670,761	292,781
3	うち、安定預金の額	1,068,559	32,056	1,067,690	32,030
4	うち、準安定預金の額	2,617,280	262,160	2,602,970	260,751
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,685,089	994,253	1,705,500	1,031,199
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	1,431,989	741,153	1,439,266	764,965
8	うち、負債性有価証券の額	253,100	253,100	266,234	266,234
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	1,441,109	309,822	1,401,828	300,639
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	192,898	192,898	187,373	187,373
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	1,248,211	116,924	1,214,454	113,265
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	5,108	3,749	2,628	954
15	偶発事象に係る資金流出額	39,395	9,287	43,470	9,190
16	資金流出合計額	1,611,330		1,634,765	
<b>資金流入額 (3)</b>		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	360,130	198,446	395,564	221,282
19	その他資金流入額	240,575	207,849	216,059	201,542
20	資金流入合計額	600,705	406,295	611,623	422,824
<b>単体流動性カバレッジ比率 (4)</b>					
21	算入可能適格流動資産の合計額	1,618,393		1,430,392	
22	純資金流出額	1,205,035		1,211,940	
23	単体流動性カバレッジ比率	134.3%		118.0%	
24	平均値計算用データ数	59件		58件	

<流動性規制に関する開示>

(KM1 主要な指標)

連結流動性カバレッジ比率に関する定量的事項(2020年3月期 第1四半期)

(単位:百万円、%)

国際様式の 該当番号		2019年6月期	2019年3月期	2018年12月期	2018年9月期	2018年6月期
連結流動性カバレッジ比率						
15	算入可能適格流動性資産の合計額	1,618,393	1,430,392	1,484,412	1,407,791	1,454,618
16	純資金流出額	1,226,224	1,233,979	1,303,315	1,269,999	1,248,147
17	連結流動性カバレッジ比率	131.9%	115.9%	113.8%	110.8%	116.5%

単体流動性カバレッジ比率に関する定量的事項(2020年3月期 第1四半期)

(単位:百万円、%)

国際様式の 該当番号		2019年6月期	2019年3月期	2018年12月期	2018年9月期	2018年6月期
単体流動性カバレッジ比率						
15	算入可能適格流動性資産の合計額	1,618,393	1,430,392	1,484,412	1,407,791	1,454,618
16	純資金流出額	1,205,035	1,211,940	1,281,478	1,249,516	1,228,149
17	単体流動性カバレッジ比率	134.3%	118.0%	115.8%	112.6%	118.4%