

<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	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,618,393		1,430,392	
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	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	
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	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
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	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	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,618,393		1,430,392	
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	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	
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	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
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	1,618,393		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%