

# 〔経営の健全性の状況のうち、流動性に係る健全性を判断するための基準に係る事項<定量的開示事項>〕

## (流動性カバレッジ比率に関する定量的事項【連結】)

(単位：百万円、%、件)

項目		2020年3月期 第2四半期		2020年3月期 第1四半期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,560,418		1,618,393	
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	3,719,242	296,012	3,685,934	294,217
3	うち、安定預金の額	1,090,331	32,709	1,068,559	32,056
4	うち、準安定預金の額	2,628,846	263,303	2,617,280	262,160
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,716,698	1,047,812	1,694,949	1,004,113
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	1,441,530	772,644	1,442,548	751,711
8	うち、負債性有価証券の額	275,168	275,168	252,401	252,401
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	1,408,931	284,314	1,441,109	309,822
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	168,068	168,068	192,898	192,898
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	1,240,863	116,245	1,248,211	116,924
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	3,388	2,535	5,108	3,749
15	偶発事象に係る資金流出額	37,591	9,243	39,395	9,287
16	資金流出合計額	1,639,919		1,621,191	
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	20	—	—	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	376,220	202,381	348,805	187,121
19	その他資金流入額	220,036	190,359	240,570	207,845
20	資金流入合計額	596,276	392,741	589,376	394,966
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	1,560,418		1,618,393	
22	純資金流出額	1,247,178		1,226,224	
23	連結流動性カバレッジ比率	125.1%		131.9%	
24	平均値計算用データ数	62件		59件	

(流動性カバレッジ比率に関する定量的事項【単体】)

(単位：百万円、%、件)

項目		2020年3月期 第2四半期		2020年3月期 第1四半期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,560,418		1,618,393	
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	3,719,242	296,012	3,685,934	294,217
3	うち、安定預金の額	1,090,331	32,709	1,068,559	32,056
4	うち、準安定預金の額	2,628,846	263,303	2,617,280	262,160
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,706,796	1,037,910	1,685,089	994,253
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	1,430,296	761,410	1,431,989	741,153
8	うち、負債性有価証券の額	276,500	276,500	253,100	253,100
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	1,408,931	284,314	1,441,109	309,822
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	168,068	168,068	192,898	192,898
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	1,240,863	116,245	1,248,211	116,924
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	3,388	2,535	5,108	3,749
15	偶発事象に係る資金流出額	37,591	9,243	39,395	9,287
16	資金流出合計額	1,630,017		1,611,330	
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	20	—	—	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	387,347	213,503	360,130	198,446
19	その他資金流入額	220,040	190,363	240,575	207,849
20	資金流入合計額	607,407	403,867	600,705	406,295
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	1,560,418		1,618,393	
22	純資金流出額	1,226,150		1,205,035	
23	単体流動性カバレッジ比率	127.2%		134.3%	
24	平均値計算用データ数	62件		59件	