

[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4四半期		2020年3月期 第3四半期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,590,923		1,633,807	
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	3,762,820	299,047	3,727,120	296,760
3	うち、安定預金の額	1,110,341	33,310	1,090,914	32,727
4	うち、準安定預金の額	2,652,361	265,736	2,636,106	264,032
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,832,147	1,122,655	1,798,232	1,111,995
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	1,548,677	839,185	1,532,266	846,030
8	うち、負債性有価証券の額	283,470	283,470	265,965	265,965
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		21,418		23,906
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	1,498,175	372,885	1,417,170	289,722
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	259,311	259,311	172,771	172,771
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	1,238,864	113,573	1,244,399	116,951
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	10,486	2,646	4,277	2,584
15	偶発事象に係る資金流出額	33,089	8,098	35,554	8,704
16	資金流出合計額		1,826,751		1,733,674
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	374,830	201,668	346,047	186,855
19	その他資金流入額	332,122	296,626	226,604	188,395
20	資金流入合計額	706,953	498,294	572,652	375,251
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		1,590,923		1,633,807
22	純資金流出額		1,328,456		1,358,423
23	連結流動性カバレッジ比率		119.7%		120.2%
24	平均値計算用データ数	58件		62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4四半期		2020年3月期 第3四半期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,590,923		1,633,807	
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	3,762,820	299,047	3,727,120	296,760
3	うち、安定預金の額	1,110,341	33,310	1,090,914	32,727
4	うち、準安定預金の額	2,652,361	265,736	2,636,106	264,032
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,819,003	1,109,512	1,788,084	1,101,848
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	1,534,242	824,750	1,521,395	835,158
8	うち、負債性有価証券の額	284,761	284,761	266,689	266,689
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		21,418		23,906
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	1,498,175	372,885	1,417,170	289,722
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	259,311	259,311	172,771	172,771
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	1,238,864	113,573	1,244,399	116,951
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	10,486	2,646	4,277	2,585
15	偶発事象に係る資金流出額	33,089	8,098	35,554	8,704
16	資金流出合計額		1,813,607		1,723,527
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	386,811	213,644	357,643	198,450
19	その他資金流入額	332,126	296,630	226,608	188,399
20	資金流入合計額	718,938	510,274	584,252	386,849
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		1,590,923		1,633,807
22	純資金流出額		1,303,333		1,336,677
23	単体流動性カバレッジ比率		122.0%		122.2%
24	平均値計算用データ数	58件		62件	