

単体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                                      | 2,617,264    |              | 2,453,997    |              |
| <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                             | 9,308,458    | 749,180      | 9,255,252    | 743,290      |
| 3                       | うち、安定預金の額                                       | 2,595,223    | 77,856       | 2,603,357    | 78,100       |
| 4                       | うち、準安定預金の額                                      | 6,713,235    | 671,323      | 6,651,895    | 665,189      |
| 5                       | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                           | 2,906,937    | 1,323,771    | 2,806,611    | 1,340,181    |
| 6                       | うち、適格オペレーショナル預金の額                               | 0            | 0            | 0            | 0            |
| 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 | 2,721,113    | 1,137,947    | 2,600,876    | 1,134,447    |
| 8                       | うち、負債性有価証券の額                                    | 185,823      | 185,823      | 205,734      | 205,734      |
| 9                       | 有担保資金調達等に係る資金流出額                                |              | 3,927        |              | 4,754        |
| 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       | 1,631,782    | 190,620      | 1,618,462    | 177,528      |
| 11                      | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                            | 77,226       | 77,226       | 64,781       | 64,781       |
| 12                      | うち、資金調達プログラムに係る資金流出額                            | 0            | 0            | 0            | 0            |
| 13                      | うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額                         | 1,554,555    | 113,393      | 1,553,680    | 112,747      |
| 14                      | 資金提供義務に基づく資金流出額等                                | 30,322       | 17,796       | 32,709       | 24,301       |
| 15                      | 偶発事象に係る資金流出額                                    | 1,680,237    | 66,517       | 1,621,374    | 65,513       |
| 16                      | 資金流出合計額   |              | 2,351,812    |              | 2,355,570    |
| <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                                | 0            | 0            | 0            | 0            |
| 18                      | 貸付金等の回収に係る資金流入額                                 | 456,925      | 311,177      | 524,627      | 341,632      |
| 19                      | その他資金流入額  | 181,697      | 149,134      | 235,001      | 202,691      |
| 20                      | 資金流入合計額   | 638,622      | 460,312      | 759,628      | 544,324      |
| <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                                  |              | 2,617,264    |              | 2,453,997    |
| 22                      | 純資金流出額  |              | 1,891,500    |              | 1,811,245    |
| 23                      | 単体流動性カバレッジ比率                                    |              | 138.3        |              | 135.4        |
| 24                      | 平均値計算用データ数                                      |              | 59           |              | 58           |