

連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

(単位:百万円、%、件)

| 項目 | | 当四半期 (2020/1-3) | | 前四半期 (2019/10-12) | |
|-------------------------|---|--------------------|------------------|----------------------|------------------|
| 適格流動資産 (1) | | | | | |
| 1 | 適格流動資産の合計額 | 26,876,939 | | 26,893,875 | |
| 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 | 43,222 | 4,297 | 44,647 | 4,438 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 360 | 11 | 375 | 11 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 42,863 | 4,286 | 44,272 | 4,427 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 10,364,437 | 7,479,864 | 10,249,629 | 7,298,204 |
| 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 | 9,457,456 | 6,572,883 | 9,534,329 | 6,582,904 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 906,980 | 906,980 | 715,299 | 715,299 |
| 9 | 有担保資金調達等に係る資金流出額 | 224,631 | | 134,665 | |
| 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 | 2,576,534 | 1,358,633 | 2,819,119 | 1,635,130 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 1,094,657 | 1,094,657 | 1,358,068 | 1,358,068 |
| 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 | 1,481,877 | 263,976 | 1,461,051 | 277,062 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 4,682,579 | 670,063 | 5,139,839 | 583,392 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 5,035,270 | 148,388 | 5,160,220 | 196,132 |
| 16 | 資金流出合計額 | 9,885,876 | | 9,851,962 | |
| 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 | 2,822 | 0 | 198,195 | 0 |
| 18 | 貸付金等の回収に係る資金流入額 | 3,208,763 | 2,298,499 | 2,927,099 | 2,215,085 |
| 19 | その他資金流入額 | 4,825,105 | 485,746 | 5,254,560 | 613,796 |
| 20 | 資金流入合計額 | 8,036,690 | 2,784,245 | 8,379,854 | 2,828,881 |
| 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 | 26,876,939 | | 26,893,875 | |
| 22 | 純資金流出額 | 7,101,631 | | 7,023,081 | |
| 23 | 連結流動性カバレッジ比率 | 378.4% | | 382.9% | |
| 24 | 平均値計算用データ数 | 58 | | 62 | |