

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（2021年3月期 第1四半期）

1. 連結流動性カバレッジ比率

（単位：百万円、%、件）

項目		当四半期		前四半期	
適格流動資産					
1	適格流動資産の合計額	1,314,738		1,073,388	
資金流出額		資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額	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	3,749,890	289,905	3,696,051	286,129
3	うち、安定預金の額	1,232,302	36,969	1,209,562	36,286
4	うち、準安定預金の額	2,517,588	252,936	2,486,488	249,842
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,142,707	505,133	929,414	387,184
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	1,112,500	474,925	904,448	362,219
8	うち、負債性有価証券の額	30,207	30,207	24,965	24,965
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		5,277		6,055
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	1,637,312	179,119	1,616,967	166,889
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	49,300	49,300	36,052	36,052
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	1,588,012	129,818	1,580,914	130,837
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	43,367	31,983	35,254	29,756
15	偶発事象に係る資金流出額	32,909	6,225	34,263	6,269
16	資金流出合計額		1,017,644		882,284
資金流入額		資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額	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	289,691	156,429	322,116	174,033
19	その他資金流入額	83,713	67,254	66,480	49,988
20	資金流入合計額	373,404	223,683	388,596	224,022
連結流動性カバレッジ比率					
21	算入可能適格流動資産の合計額		1,314,738		1,073,388
22	純資金流出額		793,960		658,262
23	連結流動性カバレッジ比率		165.5		163.0
24	平均値計算用データ数		61		58

2. 単体流動性カバレッジ比率

(単位:百万円、%、件)

項目		当四半期		前四半期	
適格流動資産					
1	適格流動資産の合計額	1,314,738		1,073,388	
資金流出額		資金流出率 を乗じる前 の額	資金流出率 を乗じた後 の額	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	3,749,892	289,905	3,696,142	286,138
3	うち、安定預金の額	1,232,302	36,969	1,209,564	36,286
4	うち、準安定預金の額	2,517,589	252,936	2,486,578	249,851
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,147,904	510,329	934,642	392,412
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	1,116,865	479,290	908,067	365,838
8	うち、負債性有価証券の額	31,038	31,038	26,574	26,574
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		5,277		6,055
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	1,624,262	181,838	1,602,777	169,262
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	49,300	49,300	36,052	36,052
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	1,574,961	132,538	1,566,725	133,209
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	22,529	11,144	14,082	8,584
15	偶発事象に係る資金流出額	32,899	6,215	34,253	6,259
16	資金流出合計額		1,004,711		868,712
資金流入額		資金流入率 を乗じる前 の額	資金流入率 を乗じた後 の額	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	293,079	159,817	326,543	178,461
19	その他資金流入額	83,713	67,254	66,484	49,992
20	資金流入合計額	376,793	227,072	393,028	228,453
単体流動性カバレッジ比率					
21	算入可能適格流動資産の合計額		1,314,738		1,073,388
22	純資金流出額		777,639		640,258
23	単体流動性カバレッジ比率		169.0		167.6
24	平均値計算用データ数		61		58