

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 中間期）

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	1,385,633		1,314,738	
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	3,881,315	297,384	3,749,890	289,905
3	うち、安定預金の額	1,314,696	39,440	1,232,302	36,969
4	うち、準安定預金の額	2,566,619	257,943	2,517,588	252,936
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,148,873	495,232	1,142,707	505,133
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	1,132,692	479,051	1,112,500	474,925
8	うち、負債性有価証券の額	16,181	16,181	30,207	30,207
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		3,997		5,277
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	1,659,546	174,886	1,637,312	179,119
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	42,548	42,548	49,300	49,300
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	1,616,998	132,337	1,588,012	129,818
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	35,025	26,498	43,367	31,983
15	偶発事象に係る資金流出額	32,296	6,135	32,909	6,225
16	資金流出合計額		1,004,135		1,017,644
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	312,850	168,017	289,691	156,429
19	その他資金流入額	66,334	50,785	83,713	67,254
20	資金流入合計額	379,185	218,802	373,404	223,683
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		1,385,633		1,314,738
22	純資金流出額		785,332		793,960
23	連結流動性カバレッジ比率		176.4		165.5
24	平均値計算用データ数		61		61

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	1,385,633		1,314,738	
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	3,881,411	297,394	3,749,892	289,905
3	うち、安定預金の額	1,314,698	39,440	1,232,302	36,969
4	うち、準安定預金の額	2,566,713	257,953	2,517,589	252,936
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,154,203	500,562	1,147,904	510,329
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	1,136,712	483,070	1,116,865	479,290
8	うち、負債性有価証券の額	17,491	17,491	31,038	31,038
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		3,997		5,277
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	1,647,112	177,755	1,624,262	181,838
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	42,548	42,548	49,300	49,300
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	1,604,563	135,206	1,574,961	132,538
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	15,352	6,825	22,529	11,144
15	偶発事象に係る資金流出額	32,287	6,125	32,899	6,215
16	資金流出合計額		992,661		1,004,711
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	316,749	171,916	293,079	159,817
19	その他資金流入額	66,338	50,789	83,713	67,254
20	資金流入合計額	383,088	222,705	376,793	227,072
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		1,385,633		1,314,738
22	純資金流出額		769,956		777,639
23	単体流動性カバレッジ比率		179.9		169.0
24	平均値計算用データ数		61		61