

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3四半期）

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	1,502,958		1,385,633	
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	3,908,634	300,411	3,881,315	297,384
3	うち、安定預金の額	1,311,589	39,347	1,314,696	39,440
4	うち、準安定預金の額	2,597,045	261,063	2,566,619	257,943
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,138,134	478,318	1,148,873	495,232
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	1,126,137	466,321	1,132,692	479,051
8	うち、負債性有価証券の額	11,997	11,997	16,181	16,181
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		3,710		3,997
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	1,688,743	177,658	1,659,546	174,886
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	40,939	40,939	42,548	42,548
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	1,647,803	136,718	1,616,998	132,337
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	41,407	28,590	35,025	26,498
15	偶発事象に係る資金流出額	34,407	7,010	32,296	6,135
16	資金流出合計額		995,699		1,004,135
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	284,610	152,066	312,850	168,017
19	その他資金流入額	64,654	46,687	66,334	50,785
20	資金流入合計額	349,264	198,753	379,185	218,802
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		1,502,958		1,385,633
22	純資金流出額		796,945		785,332
23	連結流動性カバレッジ比率		188.5		176.4
24	平均値計算用データ数		63		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	1,502,958		1,385,633	
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	3,908,634	300,411	3,881,411	297,394
3	うち、安定預金の額	1,311,589	39,347	1,314,698	39,440
4	うち、準安定預金の額	2,597,045	261,063	2,566,713	257,953
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,143,771	483,955	1,154,203	500,562
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	1,131,010	471,194	1,136,712	483,070
8	うち、負債性有価証券の額	12,761	12,761	17,491	17,491
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		3,710		3,997
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	1,677,156	180,754	1,647,112	177,755
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	40,939	40,939	42,548	42,548
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	1,636,216	139,814	1,604,563	135,206
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	21,363	8,547	15,352	6,825
15	偶発事象に係る資金流出額	34,393	6,996	32,287	6,125
16	資金流出合計額		984,374		992,661
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	287,676	155,132	316,749	171,916
19	その他資金流入額	64,654	46,687	66,338	50,789
20	資金流入合計額	352,330	201,819	383,088	222,705
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		1,502,958		1,385,633
22	純資金流出額		782,555		769,956
23	単体流動性カバレッジ比率		192.0		179.9
24	平均値計算用データ数	63		61	