

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）

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	2,060,846		1,502,958	
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	3,960,413	302,797	3,908,634	300,411
3	うち、安定預金の額	1,351,751	40,552	1,311,589	39,347
4	うち、準安定預金の額	2,608,662	262,245	2,597,045	261,063
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,325,178	639,537	1,138,134	478,318
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	1,312,579	626,938	1,126,137	466,321
8	うち、負債性有価証券の額	12,599	12,599	11,997	11,997
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		5,731		3,710
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	1,708,803	186,188	1,688,743	177,658
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	49,675	49,675	40,939	40,939
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	1,659,128	136,512	1,647,803	136,718
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	55,972	48,053	41,407	28,590
15	偶発事象に係る資金流出額	35,160	8,320	34,407	7,010
16	資金流出合計額		1,190,629		995,699
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	292,398	156,847	284,610	152,066
19	その他資金流入額	83,478	73,718	64,654	46,687
20	資金流入合計額	375,876	230,565	349,264	198,753
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		2,060,846		1,502,958
22	純資金流出額		960,063		796,945
23	連結流動性カバレッジ比率		214.6		188.5
24	平均値計算用データ数		60		63

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	2,060,846		1,502,958	
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	3,960,413	302,797	3,908,634	300,411
3	うち、安定預金の額	1,351,751	40,552	1,311,589	39,347
4	うち、準安定預金の額	2,608,662	262,245	2,597,045	261,063
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,330,983	645,342	1,143,771	483,955
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	1,316,785	631,144	1,131,010	471,194
8	うち、負債性有価証券の額	14,197	14,197	12,761	12,761
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		5,731		3,710
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	1,697,975	189,463	1,677,156	180,754
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	49,675	49,675	40,939	40,939
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	1,648,300	139,787	1,636,216	139,814
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	34,930	27,011	21,363	8,547
15	偶発事象に係る資金流出額	35,143	8,304	34,393	6,996
16	資金流出合計額		1,178,649		984,374
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	296,277	160,725	287,676	155,132
19	その他資金流入額	83,481	73,722	64,654	46,687
20	資金流入合計額	379,759	234,448	352,330	201,819
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		2,060,846		1,502,958
22	純資金流出額		944,201		782,555
23	単体流動性カバレッジ比率		218.2		192.0
24	平均値計算用データ数		60		63