

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（2022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	2,152,674		2,060,846	
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	3,989,049	305,827	3,960,413	302,797
3	うち、安定預金の額	1,347,741	40,432	1,351,751	40,552
4	うち、準安定預金の額	2,641,307	265,395	2,608,662	262,245
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,380,906	640,928	1,325,178	639,537
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	1,367,398	627,421	1,312,579	626,938
8	うち、負債性有価証券の額	13,507	13,507	12,599	12,599
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		2,343		5,731
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	1,750,364	200,614	1,708,803	186,188
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	59,245	59,245	49,675	49,675
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	1,691,119	141,369	1,659,128	136,512
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	36,917	30,382	55,972	48,053
15	偶発事象に係る資金流出額	36,144	8,433	35,160	8,320
16	資金流出合計額		1,188,530		1,190,629
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	242,174	129,135	292,398	156,847
19	その他資金流入額	103,064	69,642	83,478	73,718
20	資金流入合計額	345,238	198,778	375,876	230,565
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		2,152,674		2,060,846
22	純資金流出額		989,751		960,063
23	連結流動性カバレッジ比率		217.4		214.6
24	平均値計算用データ数		61		60

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	2,152,674		2,060,846	
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	3,989,050	305,828	3,960,413	302,797
3	うち、安定預金の額	1,347,742	40,432	1,351,751	40,552
4	うち、準安定預金の額	2,641,308	265,395	2,608,662	262,245
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,386,623	646,645	1,330,983	645,342
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	1,372,206	632,228	1,316,785	631,144
8	うち、負債性有価証券の額	14,416	14,416	14,197	14,197
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		2,343		5,731
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	1,740,015	203,955	1,697,975	189,463
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	59,245	59,245	49,675	49,675
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	1,680,769	144,709	1,648,300	139,787
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	16,167	9,632	34,930	27,011
15	偶発事象に係る資金流出額	36,128	8,417	35,143	8,304
16	資金流出合計額		1,176,821		1,178,649
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	245,448	132,409	296,277	160,725
19	その他資金流入額	103,064	69,642	83,481	73,722
20	資金流入合計額	348,512	202,052	379,759	234,448
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		2,152,674		2,060,846
22	純資金流出額		974,769		944,201
23	単体流動性カバレッジ比率		220.8		218.2
24	平均値計算用データ数		61		60