

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 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	2,012,283		2,152,674	
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	4,034,437	307,836	3,989,049	305,827
3	うち、安定預金の額	1,382,908	41,487	1,347,741	40,432
4	うち、準安定預金の額	2,651,529	266,349	2,641,307	265,395
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,224,508	514,912	1,380,906	640,928
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	1,217,608	508,012	1,367,398	627,421
8	うち、負債性有価証券の額	6,899	6,899	13,507	13,507
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		2,290		2,343
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	1,716,319	177,959	1,750,364	200,614
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	37,533	37,533	59,245	59,245
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	1,678,785	140,426	1,691,119	141,369
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	32,134	30,224	36,917	30,382
15	偶発事象に係る資金流出額	38,792	9,779	36,144	8,433
16	資金流出合計額		1,043,002		1,188,530
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	242,131	128,742	242,174	129,135
19	その他資金流入額	66,633	44,494	103,064	69,642
20	資金流入合計額	308,765	173,237	345,238	198,778
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		2,012,283		2,152,674
22	純資金流出額		869,764		989,751
23	連結流動性カバレッジ比率		231.3		217.4
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	2,012,283		2,152,674	
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	4,034,499	307,842	3,989,050	305,828
3	うち、安定預金の額	1,382,911	41,487	1,347,742	40,432
4	うち、準安定預金の額	2,651,588	266,355	2,641,308	265,395
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,230,518	520,922	1,386,623	646,645
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	1,222,437	512,841	1,372,206	632,228
8	うち、負債性有価証券の額	8,080	8,080	14,416	14,416
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		2,290		2,343
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	1,706,189	181,257	1,740,015	203,955
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	37,533	37,533	59,245	59,245
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	1,668,655	143,723	1,680,769	144,709
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	12,452	10,542	16,167	9,632
15	偶発事象に係る資金流出額	38,777	9,764	36,128	8,417
16	資金流出合計額		1,032,619		1,176,821
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	245,376	131,987	245,448	132,409
19	その他資金流入額	66,636	44,497	103,064	69,642
20	資金流入合計額	312,013	176,485	348,512	202,052
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		2,012,283		2,152,674
22	純資金流出額		856,133		974,769
23	単体流動性カバレッジ比率		235.0		220.8
24	平均値計算用データ数	61		61	