

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	2,023,615		2,012,283	
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	4,051,511	309,453	4,034,437	307,836
3	うち、安定預金の額	1,381,792	41,453	1,382,908	41,487
4	うち、準安定預金の額	2,669,718	267,999	2,651,529	266,349
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,184,563	496,755	1,224,508	514,912
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	1,171,342	483,534	1,217,608	508,012
8	うち、負債性有価証券の額	13,220	13,220	6,899	6,899
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		3,757		2,290
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	1,693,459	180,483	1,716,319	177,959
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	42,056	42,056	37,533	37,533
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	1,651,403	138,427	1,678,785	140,426
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	39,065	32,888	32,134	30,224
15	偶発事象に係る資金流出額	39,253	10,101	38,792	9,779
16	資金流出合計額		1,033,440		1,043,002
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	231,781	121,881	242,131	128,742
19	その他資金流入額	91,524	54,755	66,633	44,494
20	資金流入合計額	323,305	176,636	308,765	173,237
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		2,023,615		2,012,283
22	純資金流出額		856,803		869,764
23	連結流動性カバレッジ比率		236.1		231.3
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	2,023,615		2,012,283	
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	4,051,511	309,453	4,034,499	307,842
3	うち、安定預金の額	1,381,792	41,453	1,382,911	41,487
4	うち、準安定預金の額	2,669,718	267,999	2,651,588	266,355
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,190,251	502,443	1,230,518	520,922
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	1,176,241	488,434	1,222,437	512,841
8	うち、負債性有価証券の額	14,009	14,009	8,080	8,080
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		3,757		2,290
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	1,683,786	183,862	1,706,189	181,257
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	42,056	42,056	37,533	37,533
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	1,641,730	141,806	1,668,655	143,723
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	19,251	13,075	12,452	10,542
15	偶発事象に係る資金流出額	39,243	10,091	38,777	9,764
16	資金流出合計額		1,022,684		1,032,619
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	234,684	124,784	245,376	131,987
19	その他資金流入額	91,524	54,755	66,636	44,497
20	資金流入合計額	326,209	179,540	312,013	176,485
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		2,023,615		2,012,283
22	純資金流出額		843,144		856,133
23	単体流動性カバレッジ比率		240.0		235.0
24	平均値計算用データ数	63		61	