

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）

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	2,202,343		2,023,615	
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	4,101,942	312,080	4,051,511	309,453
3	うち、安定預金の額	1,414,219	42,426	1,381,792	41,453
4	うち、準安定預金の額	2,687,722	269,653	2,669,718	267,999
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,351,362	642,598	1,184,563	496,755
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	1,343,576	634,812	1,171,342	483,534
8	うち、負債性有価証券の額	7,786	7,786	13,220	13,220
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		4,581		3,757
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	1,691,482	179,236	1,693,459	180,483
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	40,425	40,425	42,056	42,056
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	1,651,057	138,810	1,651,403	138,427
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	66,041	51,925	39,065	32,888
15	偶発事象に係る資金流出額	42,680	12,016	39,253	10,101
16	資金流出合計額		1,202,438		1,033,440
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	256,935	135,088	231,781	121,881
19	その他資金流入額	91,981	70,018	91,524	54,755
20	資金流入合計額	348,917	205,107	323,305	176,636
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		2,202,343		2,023,615
22	純資金流出額		997,331		856,803
23	連結流動性カバレッジ比率		220.8		236.1
24	平均値計算用データ数		59		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	2,202,343		2,023,615	
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	4,101,942	312,080	4,051,511	309,453
3	うち、安定預金の額	1,414,219	42,426	1,381,792	41,453
4	うち、準安定預金の額	2,687,722	269,653	2,669,718	267,999
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,357,997	649,232	1,190,251	502,443
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	1,348,458	639,694	1,176,241	488,434
8	うち、負債性有価証券の額	9,538	9,538	14,009	14,009
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		4,581		3,757
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	1,682,316	182,732	1,683,786	183,862
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	40,425	40,425	42,056	42,056
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	1,641,890	142,306	1,641,730	141,806
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	45,600	31,483	19,251	13,075
15	偶発事象に係る資金流出額	42,675	12,012	39,243	10,091
16	資金流出合計額		1,192,123		1,022,684
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	260,400	138,552	234,684	124,784
19	その他資金流入額	91,984	70,022	91,524	54,755
20	資金流入合計額	352,385	208,574	326,209	179,540
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		2,202,343		2,023,615
22	純資金流出額		983,548		843,144
23	単体流動性カバレッジ比率		223.9		240.0
24	平均値計算用データ数		59		63