

IV. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項【連結・単体共通】

1. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項【連結】

(単位：百万円、%、件)

項目		2021年度第4四半期 (2022年1月1日から2022年3月31日まで)		2021年度第3四半期 (2021年10月1日から2021年12月31日まで)	
		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
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	2,233,787		2,185,058	
資金流出額 (2)					
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	5,710,728	450,272	5,653,133	447,986
3	うち、安定預金の額	1,910,514	57,315	1,863,525	55,905
4	うち、準安定預金の額	3,800,214	392,956	3,789,607	392,080
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,016,808	895,698	2,034,759	904,955
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	1,891,480	770,370	1,916,479	786,674
8	うち、負債性有価証券の額	125,327	125,327	118,280	118,280
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		14,964		1,527
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	1,642,818	187,846	1,677,564	199,113
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	48,344	48,344	57,354	57,354
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	1,594,474	139,501	1,620,209	141,759
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	83,919	63,414	73,711	59,570
15	偶発事象に係る資金流出額	50,791	16,779	50,191	15,898
16	資金流出合計額		1,628,975		1,629,052
資金流入額 (3)					
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	816,905	662,690	780,006	640,544
19	その他資金流入額	117,352	78,243	115,416	89,744
20	資金流入合計額	934,258	740,933	895,423	730,289
連結流動性カバレッジ比率 (4)					
21	算入可能適格流動資産の合計額		2,233,787		2,185,058
22	純資金流出額		888,041		898,763
23	連結流動性カバレッジ比率		251.5		243.1
24	平均値計算用データ数		59		63

2. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項【単体】

(単位：百万円、%、件)

項目		2021年度第4四半期 (2022年1月1日から2022年3月31日まで)		2021年度第3四半期 (2021年10月1日から2021年12月31日まで)	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	2,233,787		2,185,058	
資金流出額 (2)		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	5,710,728	450,272	5,653,133	447,986
3	うち、安定預金の額	1,910,514	57,315	1,863,525	55,905
4	うち、準安定預金の額	3,800,214	392,956	3,789,607	392,080
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,027,942	906,831	2,046,290	916,485
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	1,901,355	780,245	1,927,176	797,371
8	うち、負債性有価証券の額	126,586	126,586	119,114	119,114
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		14,964		1,527
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	1,649,646	190,042	1,684,347	201,296
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	48,359	48,359	57,359	57,359
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	1,601,286	141,683	1,626,987	143,937
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	55,328	34,823	46,658	32,517
15	偶発事象に係る資金流出額	50,791	16,779	50,191	15,898
16	資金流出合計額		1,613,714		1,615,713
資金流入額 (3)		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	817,391	662,933	780,427	640,754
19	その他資金流入額	117,372	78,263	115,425	89,753
20	資金流入合計額	934,763	741,196	895,852	730,508
単体流動性カバレッジ比率 (4)					
21	算入可能適格流動資産の合計額		2,233,787		2,185,058
22	純資金流出額		872,517		885,205
23	単体流動性カバレッジ比率		256.0		246.8
24	平均値計算用データ数		59		63