

「流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項」

【連結】2021年3月期(別紙様式第二号)

(単位:百万円、%、件)

項目		当四半期		前四半期	
適格流動資産(1)					
1	適格流動資産の合計額	1,744,312		1,776,328	
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	5,507,461	431,280	5,438,256	425,641
3	うち、安定預金の額	1,902,254	57,067	1,882,538	56,476
4	うち、準安定預金の額	3,605,207	374,213	3,555,717	369,165
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,954,346	894,638	1,943,035	864,634
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	1,821,895	762,187	1,808,000	729,600
8	うち、負債性有価証券の額	132,451	132,451	135,034	135,034
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		4,819		14,032
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	1,661,525	201,768	1,675,310	200,375
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	63,337	63,337	59,849	59,849
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	1,598,187	138,431	1,615,460	140,526
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	68,085	57,722	75,901	69,183
15	偶発事象に係る資金流出額	45,110	12,744	42,613	10,665
16	資金流出合計額		1,602,975		1,584,533
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	809,583	639,769	759,267	606,682
19	その他資金流入額	126,526	99,015	116,594	91,918
20	資金流入合計額	936,109	738,784	875,861	698,600
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		1,744,312		1,776,328
22	純資金流出額		864,190		885,932
23	連結流動性カバレッジ比率		201.8		200.5
24	平均値計算用データ数	60		63	

「流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項」

【単体】2021年3月期(別紙様式第一号)

(単位:百万円、%、件)

項目		当四半期		前四半期	
適格流動資産(1)					
1	適格流動資産の合計額	1,744,312		1,776,328	
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	5,507,461	431,280	5,438,256	425,641
3	うち、安定預金の額	1,902,254	57,067	1,882,538	56,476
4	うち、準安定預金の額	3,605,207	374,213	3,555,717	369,165
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,965,300	905,592	1,952,700	874,299
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	1,831,632	771,924	1,816,886	738,485
8	うち、負債性有価証券の額	133,667	133,667	135,814	135,814
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		4,819		14,032
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	1,668,653	204,006	1,681,984	202,509
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	63,365	63,365	59,852	59,852
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	1,605,287	140,641	1,622,132	142,657
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	40,875	30,512	50,415	43,698
15	偶発事象に係る資金流出額	45,110	12,744	42,613	10,665
16	資金流出合計額		1,588,956		1,570,846
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	809,892	639,923	759,814	607,015
19	その他資金流入額	126,558	99,048	116,601	91,924
20	資金流入合計額	936,451	738,971	876,415	698,940
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		1,744,312		1,776,328
22	純資金流出額		849,985		871,906
23	単体流動性カバレッジ比率		205.2		203.7
24	平均値計算用データ数	60		63	