

「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6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	1,861,322		1,744,312	
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	5,561,329	441,083	5,507,461	431,280
3	うち、安定預金の額	1,838,631	55,158	1,902,254	57,067
4	うち、準安定預金の額	3,722,697	385,924	3,605,207	374,213
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,051,436	877,165	1,954,346	894,638
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	1,971,994	797,723	1,821,895	762,187
8	うち、負債性有価証券の額	79,441	79,441	132,451	132,451
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		6,289		4,819
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	1,679,433	199,297	1,661,525	201,768
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	57,470	57,470	63,337	63,337
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	1,621,963	141,827	1,598,187	138,431
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	70,417	58,950	68,085	57,722
15	偶発事象に係る資金流出額	48,476	16,315	45,110	12,744
16	資金流出合計額		1,599,101		1,602,975
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	796,172	643,933	809,583	639,769
19	その他資金流入額	109,207	84,157	126,526	99,015
20	資金流入合計額	905,380	728,091	936,109	738,784
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		1,861,322		1,744,312
22	純資金流出額		871,009		864,190
23	連結流動性カバレッジ比率		213.6		201.8
24	平均値計算用データ数	61		60	

「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6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	1,861,322		1,744,312	
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	5,561,329	441,083	5,507,461	431,280
3	うち、安定預金の額	1,838,631	55,158	1,902,254	57,067
4	うち、準安定預金の額	3,722,697	385,924	3,605,207	374,213
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,062,780	888,509	1,965,300	905,592
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	1,982,462	808,191	1,831,632	771,924
8	うち、負債性有価証券の額	80,317	80,317	133,667	133,667
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		6,289		4,819
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	1,686,296	201,456	1,668,653	204,006
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	57,481	57,481	63,365	63,365
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	1,628,815	143,975	1,605,287	140,641
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	42,264	30,797	40,875	30,512
15	偶発事象に係る資金流出額	48,476	16,315	45,110	12,744
16	資金流出合計額		1,584,451		1,588,956
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	796,713	644,265	809,892	639,923
19	その他資金流入額	109,222	84,173	126,558	99,048
20	資金流入合計額	905,936	728,438	936,451	738,971
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		1,861,322		1,744,312
22	純資金流出額		856,012		849,985
23	単体流動性カバレッジ比率		217.4		205.2
24	平均値計算用データ数	61		60	