

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9月期(別紙様式第四号)

(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	1,927,859		1,861,322	
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	5,630,385	444,629	5,561,329	441,083
3	うち、安定預金の額	1,882,953	56,488	1,838,631	55,158
4	うち、準安定預金の額	3,747,431	388,141	3,722,697	385,924
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,004,895	881,771	2,051,436	877,165
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	1,892,350	769,226	1,971,994	797,723
8	うち、負債性有価証券の額	112,544	112,544	79,441	79,441
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		1,197		6,289
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	1,685,105	202,636	1,679,433	199,297
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	60,650	60,650	57,470	57,470
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	1,624,455	141,986	1,621,963	141,827
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	65,002	57,784	70,417	58,950
15	偶発事象に係る資金流出額	49,361	16,116	48,476	16,315
16	資金流出合計額		1,604,136		1,599,101
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	767,052	626,952	796,172	643,933
19	その他資金流入額	111,386	78,326	109,207	84,157
20	資金流入合計額	878,439	705,278	905,380	728,091
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		1,927,859		1,861,322
22	純資金流出額		898,857		871,009
23	連結流動性カバレッジ比率		214.4		213.6
24	平均値計算用データ数	61		61	

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9月期(別紙様式第三号)

(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	1,927,859		1,861,322	
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	5,630,385	444,629	5,561,329	441,083
3	うち、安定預金の額	1,882,953	56,488	1,838,631	55,158
4	うち、準安定預金の額	3,747,431	388,141	3,722,697	385,924
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,015,516	892,392	2,062,780	888,509
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	1,901,854	778,730	1,982,462	808,191
8	うち、負債性有価証券の額	113,662	113,662	80,317	80,317
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		1,197		6,289
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	1,691,927	204,822	1,686,296	201,456
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	60,653	60,653	57,481	57,481
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	1,631,273	144,168	1,628,815	143,975
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	37,970	30,753	42,264	30,797
15	偶発事象に係る資金流出額	49,361	16,116	48,476	16,315
16	資金流出合計額		1,589,911		1,584,451
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	767,555	627,204	796,713	644,265
19	その他資金流入額	111,394	78,333	109,222	84,173
20	資金流入合計額	878,949	705,537	905,936	728,438
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		1,927,859		1,861,322
22	純資金流出額		884,373		856,012
23	単体流動性カバレッジ比率		217.9		217.4
24	平均値計算用データ数	61		61	