

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12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                                      | 2,185,058    |              | 1,927,859    |              |
| 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                             | 5,653,133    | 447,986      | 5,630,385    | 444,629      |
| 3                | うち、安定預金の額                                       | 1,863,525    | 55,905       | 1,882,953    | 56,488       |
| 4                | うち、準安定預金の額                                      | 3,789,607    | 392,080      | 3,747,431    | 388,141      |
| 5                | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                           | 2,034,759    | 904,955      | 2,004,895    | 881,771      |
| 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 | 1,916,479    | 786,674      | 1,892,350    | 769,226      |
| 8                | うち、負債性有価証券の額                                    | 118,280      | 118,280      | 112,544      | 112,544      |
| 9                | 有担保資金調達等に係る資金流出額                                |              | 1,527        |              | 1,197        |
| 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       | 1,677,564    | 199,113      | 1,685,105    | 202,636      |
| 11               | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                            | 57,354       | 57,354       | 60,650       | 60,650       |
| 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                         | 1,620,209    | 141,759      | 1,624,455    | 141,986      |
| 14               | 資金提供義務等に基づく資金流出額等                               | 73,711       | 59,570       | 65,002       | 57,784       |
| 15               | 偶発事象に係る資金流出額                                    | 50,191       | 15,898       | 49,361       | 16,116       |
| 16               | 資金流出合計額   |              | 1,629,052    |              | 1,604,136    |
| 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                                 | 780,006      | 640,544      | 767,052      | 626,952      |
| 19               | その他資金流入額  | 115,416      | 89,744       | 111,386      | 78,326       |
| 20               | 資金流入合計額   | 895,423      | 730,289      | 878,439      | 705,278      |
| 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                                  |              | 2,185,058    |              | 1,927,859    |
| 22               | 純資金流出額  |              | 898,763      |              | 898,857      |
| 23               | 連結流動性カバレッジ比率                                    |              | 243.1        |              | 214.4        |
| 24               | 平均値計算用データ数                                      | 63           |              | 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12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                                      | 2,185,058    |              | 1,927,859    |              |
| 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                             | 5,653,133    | 447,986      | 5,630,385    | 444,629      |
| 3                | うち、安定預金の額                                       | 1,863,525    | 55,905       | 1,882,953    | 56,488       |
| 4                | うち、準安定預金の額                                      | 3,789,607    | 392,080      | 3,747,431    | 388,141      |
| 5                | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                           | 2,046,290    | 916,485      | 2,015,516    | 892,392      |
| 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 | 1,927,176    | 797,371      | 1,901,854    | 778,730      |
| 8                | うち、負債性有価証券の額                                    | 119,114      | 119,114      | 113,662      | 113,662      |
| 9                | 有担保資金調達等に係る資金流出額                                |              | 1,527        |              | 1,197        |
| 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       | 1,684,347    | 201,296      | 1,691,927    | 204,822      |
| 11               | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                            | 57,359       | 57,359       | 60,653       | 60,653       |
| 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                         | 1,626,987    | 143,937      | 1,631,273    | 144,168      |
| 14               | 資金提供義務等に基づく資金流出額等                               | 46,658       | 32,517       | 37,970       | 30,753       |
| 15               | 偶発事象に係る資金流出額                                    | 50,191       | 15,898       | 49,361       | 16,116       |
| 16               | 資金流出合計額   |              | 1,615,713    |              | 1,589,911    |
| 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                                 | 780,427      | 640,754      | 767,555      | 627,204      |
| 19               | その他資金流入額  | 115,425      | 89,753       | 111,394      | 78,333       |
| 20               | 資金流入合計額   | 895,852      | 730,508      | 878,949      | 705,537      |
| 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                                  |              | 2,185,058    |              | 1,927,859    |
| 22               | 純資金流出額  |              | 885,205      |              | 884,373      |
| 23               | 単体流動性カバレッジ比率                                    |              | 246.8        |              | 217.9        |
| 24               | 平均値計算用データ数                                      | 63           |              | 61           |              |