

〈流動性カバレッジ比率に関する開示事項〉(2021年6月期 決算)

1. 連結流動性カバレッジ比率

(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	1,158,849		1,074,877	
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	2,919,578	220,861	2,901,885	219,271
3	うち、安定預金の額	1,025,223	30,759	1,023,111	30,696
4	うち、準安定預金の額	1,894,355	190,063	1,878,774	188,540
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,703,421	1,064,664	1,552,174	989,558
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	1,622,923	984,166	1,508,473	945,857
8	うち、負債性有価証券の額	80,497	80,497	43,701	43,701
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		73,656		93,528
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	61,791	51,829	70,212	51,676
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	50,552	50,552	49,283	49,283
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	11,238	1,276	20,928	2,392
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	111,895	85,567	109,438	85,443
15	偶発事象に係る資金流出額	567,662	16,832	572,937	16,995
16	資金流出合計額		1,513,412		1,456,474
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	82,459	82,459	77,333	77,333
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	879,182	794,239	796,792	720,032
19	その他資金流入額	136,444	118,467	125,485	120,678
20	資金流入合計額	1,098,086	995,165	999,611	918,044
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		1,158,849		1,074,877
22	純資金流出額		530,767		540,387
23	連結流動性カバレッジ比率		218.3		198.9
24	平均値計算用データ数	61		60	

上記は、平成27年金融庁告示第7号の別紙様式第2号に基づく開示事項です。

## 2. 単体流動性カバレッジ比率

(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	1,158,849		1,074,877	
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	2,919,578	220,861	2,901,885	219,271
3	うち、安定預金の額	1,025,223	30,759	1,023,111	30,696
4	うち、準安定預金の額	1,894,355	190,063	1,878,774	188,540
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,705,165	1,066,408	1,556,050	993,434
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	1,624,667	985,911	1,512,349	949,732
8	うち、負債性有価証券の額	80,497	80,497	43,701	43,701
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		73,656		93,528
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	61,791	51,829	70,212	51,676
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	50,552	50,552	49,283	49,283
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	11,238	1,276	20,928	2,392
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	110,388	84,060	108,332	84,337
15	偶発事象に係る資金流出額	559,735	16,589	558,561	16,552
16	資金流出合計額		1,513,406		1,458,800
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	82,459	82,459	77,333	77,333
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	880,607	796,323	797,983	722,519
19	その他資金流入額	136,447	118,470	125,494	120,688
20	資金流入合計額	1,099,513	997,252	1,000,811	920,540
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		1,158,849		1,074,877
22	純資金流出額		529,674		540,229
23	単体流動性カバレッジ比率		218.7		198.9
24	平均値計算用データ数	61		60	

上記は、平成27年金融庁告示第7号の別紙様式第1号に基づく開示事項です。