

〈流動性カバレッジ比率に関する開示事項〉(2021年3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	1,074,877		1,081,685	
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	2,901,885	219,271	2,862,247	217,274
3	うち、安定預金の額	1,023,111	30,696	994,916	29,850
4	うち、準安定預金の額	1,878,774	188,540	1,867,331	187,389
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,552,174	989,558	1,567,825	1,018,609
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	1,508,473	945,857	1,503,051	953,835
8	うち、負債性有価証券の額	43,701	43,701	64,774	64,774
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		93,528		77,238
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	70,212	51,676	58,010	40,534
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	49,283	49,283	38,307	38,307
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	20,928	2,392	19,703	2,227
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	109,438	85,443	91,505	74,520
15	偶発事象に係る資金流出額	572,937	16,995	575,696	17,084
16	資金流出合計額		1,456,474		1,445,262
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	77,333	77,333	89,523	89,523
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	796,792	720,032	766,476	698,535
19	その他資金流入額	125,485	120,678	107,929	95,517
20	資金流入合計額	999,611	918,044	963,929	883,576
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		1,074,877		1,081,685
22	純資金流出額		540,387		562,187
23	連結流動性カバレッジ比率		198.9		192.4
24	平均値計算用データ数	60		63	

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	1,074,877		1,081,685	
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	2,901,885	219,271	2,862,247	217,274
3	うち、安定預金の額	1,023,111	30,696	994,916	29,850
4	うち、準安定預金の額	1,878,774	188,540	1,867,331	187,389
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,556,050	993,434	1,571,542	1,022,326
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	1,512,349	949,732	1,506,768	957,552
8	うち、負債性有価証券の額	43,701	43,701	64,774	64,774
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		93,528		77,238
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	70,212	51,676	58,010	40,534
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	49,283	49,283	38,307	38,307
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	20,928	2,392	19,703	2,227
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	108,332	84,337	90,415	73,430
15	偶発事象に係る資金流出額	558,561	16,552	561,312	16,641
16	資金流出合計額		1,458,800		1,447,446
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	77,333	77,333	89,523	89,523
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	797,983	722,519	767,454	700,820
19	その他資金流入額	125,494	120,688	107,938	95,527
20	資金流入合計額	1,000,811	920,540	964,916	885,870
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		1,074,877		1,081,685
22	純資金流出額		540,229		562,145
23	単体流動性カバレッジ比率		198.9		192.4
24	平均値計算用データ数	60		63	

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。