

# Ⅲ. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

## 1. 連結流動性カバレッジ比率

(単位：百万円、%、件)

項 目		2021年3月期		2020年12月期	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	2,873,435		2,050,350	
<b>資金流出額 (2)</b>		<b>資金流出率を乗じる前の額</b>	<b>資金流出率を乗じた後の額</b>	<b>資金流出率を乗じる前の額</b>	<b>資金流出率を乗じた後の額</b>
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	5,260,245	441,479	5,192,868	436,362
3	うち、安定預金の額	1,215,224	36,456	1,191,972	35,759
4	うち、準安定預金の額	4,045,020	405,022	4,000,895	400,603
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,312,265	1,114,851	1,954,883	797,493
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	2,243,502	1,046,089	1,912,229	754,840
8	うち、負債性有価証券の額	68,762	68,762	42,653	42,653
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		25,471		24,567
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	126,982	29,398	120,404	25,362
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	15,560	15,560	12,070	12,070
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	111,422	13,838	108,334	13,292
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	36,722	30,192	34,472	26,212
15	偶発事象に係る資金流出額	1,144,466	32,946	1,192,847	33,461
16	資金流出合計額		1,674,341		1,343,460
<b>資金流入額 (3)</b>		<b>資金流入率を乗じる前の額</b>	<b>資金流入率を乗じた後の額</b>	<b>資金流入率を乗じる前の額</b>	<b>資金流入率を乗じた後の額</b>
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	307,173	160,399	245,511	129,020
19	その他資金流入額	46,471	16,521	50,589	20,915
20	資金流入合計額	353,644	176,920	296,100	149,936
<b>連結流動性カバレッジ比率 (4)</b>					
21	算入可能適格流動資産の合計額		2,873,435		2,050,350
22	純資金流出額		1,497,420		1,193,524
23	連結流動性カバレッジ比率		191.8%		171.7%
24	平均値計算用データ数		60		63

## 2. 単体流動性カバレッジ比率

(単位：百万円、%、件)

項 目		2021年3月期		2020年12月期	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	2,873,435		2,050,350	
<b>資金流出額 (2)</b>		<b>資金流出率を乗じる前の額</b>	<b>資金流出率を乗じた後の額</b>	<b>資金流出率を乗じる前の額</b>	<b>資金流出率を乗じた後の額</b>
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	5,260,245	441,479	5,192,868	436,362
3	うち、安定預金の額	1,215,224	36,456	1,191,972	35,759
4	うち、準安定預金の額	4,045,020	405,022	4,000,895	400,603
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,323,602	1,126,188	1,965,209	807,820
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	2,252,470	1,055,056	1,920,739	763,349
8	うち、負債性有価証券の額	71,132	71,132	44,470	44,470
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		25,471		24,567
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	126,983	29,399	120,404	25,362
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	15,561	15,561	12,070	12,070
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	111,422	13,838	108,334	13,292
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	11,416	4,886	11,106	2,846
15	偶発事象に係る資金流出額	1,157,399	32,946	1,201,672	33,461
16	資金流出合計額		1,660,372		1,330,421
<b>資金流入額 (3)</b>		<b>資金流入率を乗じる前の額</b>	<b>資金流入率を乗じた後の額</b>	<b>資金流入率を乗じる前の額</b>	<b>資金流入率を乗じた後の額</b>
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	321,323	174,549	259,319	142,828
19	その他資金流入額	46,492	16,542	50,611	20,937
20	資金流入合計額	367,815	191,092	309,930	163,766
<b>単体流動性カバレッジ比率 (4)</b>					
21	算入可能適格流動資産の合計額		2,873,435		2,050,350
22	純資金流出額		1,469,280		1,166,654
23	単体流動性カバレッジ比率		195.5%		175.7%
24	平均値計算用データ数		60		63