

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		2022年3月期		2021年12月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	3,138,378		3,141,158	
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	5,428,508	453,025	5,378,845	449,835
3	うち、安定預金の額	1,290,448	38,713	1,265,182	37,955
4	うち、準安定預金の額	4,138,060	414,311	4,113,663	411,880
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,340,048	1,088,341	2,292,190	1,056,312
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	2,277,094	1,025,388	2,239,340	1,003,462
8	うち、負債性有価証券の額	62,953	62,953	52,849	52,849
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		22,269		28,468
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	133,748	33,509	129,082	28,467
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	19,241	19,241	14,058	14,058
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	114,507	14,268	115,024	14,409
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	32,973	27,030	35,512	28,842
15	偶発事象に係る資金流出額	1,285,404	34,361	1,283,570	35,084
16	資金流出合計額		1,658,538		1,627,010
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	274,077	146,335	244,054	129,445
19	その他資金流入額	57,857	19,706	57,722	22,260
20	資金流入合計額	331,934	166,042	301,776	151,706
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		3,138,378		3,141,158
22	純資金流出額		1,492,495		1,475,304
23	連結流動性カバレッジ比率		210.2%		212.9%
24	平均値計算用データ数		59		63

2. 単体流動性カバレッジ比率

(単位：百万円、%、件)

項 目		2022年3月期		2021年12月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	3,138,378		3,141,158	
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	5,428,508	453,025	5,378,845	449,835
3	うち、安定預金の額	1,290,448	38,713	1,265,182	37,955
4	うち、準安定預金の額	4,138,060	414,311	4,113,663	411,880
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,351,427	1,099,721	2,303,799	1,067,921
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	2,285,957	1,034,250	2,249,105	1,013,227
8	うち、負債性有価証券の額	65,470	65,470	54,693	54,693
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		22,269		28,468
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	133,748	33,509	129,082	28,467
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	19,241	19,241	14,058	14,058
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	114,507	14,268	115,024	14,409
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	8,369	2,427	9,027	2,357
15	偶発事象に係る資金流出額	1,300,047	34,361	1,298,332	35,084
16	資金流出合計額		1,645,314		1,612,134
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	287,599	159,858	258,532	143,923
19	その他資金流入額	57,878	19,727	57,743	22,281
20	資金流入合計額	345,477	179,585	316,275	166,204
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		3,138,378		3,141,158
22	純資金流出額		1,465,728		1,445,929
23	単体流動性カバレッジ比率		214.1%		217.2%
24	平均値計算用データ数		59		63