

連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項
(2021年3月期)

(別紙様式第二号)

(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	2,873,435		2,050,350	
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	5,260,245	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	
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	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
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	2,873,435		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	