

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12月期)

(別紙様式第四号)

(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	3,141,158		3,130,876	
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	5,378,845	449,835	5,356,614	448,134
3	うち、安定預金の額	1,265,182	37,955	1,257,860	37,735
4	うち、準安定預金の額	4,113,663	411,880	4,098,754	410,398
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,292,190	1,056,312	2,314,051	1,090,659
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	2,239,340	1,003,462	2,260,685	1,037,292
8	うち、負債性有価証券の額	52,849	52,849	53,366	53,366
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	28,468		28,342	
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	129,082	28,467	129,376	29,299
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	14,058	14,058	14,793	14,793
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	115,024	14,409	114,583	14,506
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	35,512	28,842	39,439	33,794
15	偶発事象に係る資金流出額	1,283,570	35,084	1,293,461	35,946
16	資金流出合計額	1,627,010		1,666,176	
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	244,054	129,445	263,601	140,743
19	その他資金流入額	57,722	22,260	39,969	15,942
20	資金流入合計額	301,776	151,706	303,570	156,686
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	3,141,158		3,130,876	
22	純資金流出額	1,475,304		1,509,490	
23	連結流動性カバレッジ比率	212.9%		207.4%	
24	平均値計算用データ数	63		61	