

<流動性比率規制に関する開示>

連結流動性カバレッジ比率に関する定量的事項(2022年3月期 第4四半期)

(単位:百万円)

項目		当四半期		前四半期	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	2,044,276		2,047,975	
<b>資金流出額 (2)</b>		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	4,129,669	324,603	4,099,242	323,016
3	うち、安定預金の額	1,269,432	38,082	1,248,798	37,463
4	うち、準安定預金の額	2,859,881	286,520	2,850,214	285,552
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,971,226	1,061,036	1,831,586	947,629
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	1,700,271	790,082	1,566,977	683,019
8	うち、負債性有価証券の額	270,954	270,954	264,609	264,609
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	-	-	-	11,387
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	1,709,070	479,537	1,667,826	439,911
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	351,681	351,681	312,528	312,528
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	1,357,388	127,855	1,355,298	127,383
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	19,647	15,739	2,878	1,349
15	偶発事象に係る資金流出額	37,708	8,721	36,606	7,467
16	資金流出合計額	1,889,639		1,730,763	
<b>資金流入額 (3)</b>		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	349,117	187,319	312,901	169,837
19	その他資金流入額	405,116	350,781	346,169	325,915
20	資金流入合計額	754,234	538,100	659,070	495,752
<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	2,044,276		2,047,975	
22	純資金流出額	1,351,538		1,235,010	
23	連結流動性カバレッジ比率	151.2%		165.8%	
24	平均値計算用データ数	59件		63件	

<流動性比率規制に関する開示>

単体流動性カバレッジ比率に関する定量的事項(2022年3月期 第4四半期)

(単位:百万円)

項目		当四半期		前四半期	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	2,044,276		2,047,975	
<b>資金流出額 (2)</b>		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	4,129,669	324,603	4,099,242	323,016
3	うち、安定預金の額	1,269,432	38,082	1,248,798	37,463
4	うち、準安定預金の額	2,859,881	286,520	2,850,214	285,552
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,960,661	1,050,471	1,820,804	936,846
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	1,688,232	778,043	1,555,237	671,280
8	うち、負債性有価証券の額	272,428	272,428	265,566	265,566
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	-	-	-	11,387
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	1,709,070	479,537	1,667,826	439,911
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	351,681	351,681	312,528	312,528
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	1,357,388	127,855	1,355,298	127,383
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	19,647	15,739	2,878	1,349
15	偶発事象に係る資金流出額	37,708	8,721	36,606	7,467
16	資金流出合計額	1,879,074		1,719,980	
<b>資金流入額 (3)</b>		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	359,951	198,153	323,747	180,684
19	その他資金流入額	405,119	350,784	346,172	325,918
20	資金流入合計額	765,071	548,937	669,920	506,602
<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	2,044,276		2,047,975	
22	純資金流出額	1,330,136		1,213,378	
23	単体流動性カバレッジ比率	153.6%		168.7%	
24	平均値計算用データ数	59件		63件	

<流動性比率規制に関する開示>

(KM1 主要な指標)

連結流動性カバレッジ比率に関する定量的事項(2022年3月期 第4四半期)

(単位:百万円)

国際様式の 該当番号		2022年3月期	2021年12月期	2021年9月期	2021年6月期	2021年3月期
連結流動性カバレッジ比率						
15	算入可能適格流動性資産の合計額	2,044,276	2,047,975	2,108,740	2,197,946	2,009,358
16	純資金流出額	1,351,538	1,235,010	1,340,735	1,507,795	1,492,271
17	連結流動性カバレッジ比率	151.2%	165.8%	157.2%	145.7%	134.6%

単体流動性カバレッジ比率に関する定量的事項(2022年3月期 第4四半期)

(単位:百万円)

国際様式の 該当番号		2022年3月期	2021年12月期	2021年9月期	2021年6月期	2021年3月期
単体流動性カバレッジ比率						
15	算入可能適格流動性資産の合計額	2,044,276	2,047,975	2,108,740	2,197,946	2,009,358
16	純資金流出額	1,330,136	1,213,378	1,318,042	1,482,776	1,463,492
17	単体流動性カバレッジ比率	153.6%	168.7%	159.9%	148.2%	137.2%