

<流動性規制に関する開示>

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1四半期)

(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	2,197,946		2,009,358	
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	4,048,812	319,801	4,015,210	316,710
3	うち、安定預金の額	1,223,450	36,703	1,221,121	36,633
4	うち、準安定預金の額	2,825,207	283,098	2,793,971	280,076
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,141,320	1,246,374	2,115,801	1,258,852
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	1,881,255	986,309	1,851,736	994,788
8	うち、負債性有価証券の額	260,064	260,064	264,064	264,064
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	-	13,859	-	13,503
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	1,579,794	364,428	1,561,499	373,770
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	238,118	238,118	251,884	251,884
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	1,341,675	126,310	1,309,615	121,886
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	4,071	1,867	9,418	5,783
15	偶発事象に係る資金流出額	35,230	6,537	35,797	6,963
16	資金流出合計額	-	1,952,869	-	1,975,583
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	322,632	174,208	363,116	194,453
19	その他資金流入額	323,221	270,864	339,011	288,858
20	資金流入合計額	645,853	445,073	702,127	483,312
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	-	2,197,946	-	2,009,358
22	純資金流出額	-	1,507,795	-	1,492,271
23	連結流動性カバレッジ比率	-	145.7%	-	134.6%
24	平均値計算用データ数	61件		60件	

<流動性規制に関する開示>

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1四半期)

(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	2,197,946		2,009,358	
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	4,048,812	319,801	4,015,210	316,710
3	うち、安定預金の額	1,223,450	36,703	1,221,121	36,633
4	うち、準安定預金の額	2,825,207	283,098	2,793,971	280,076
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,127,209	1,232,263	2,098,117	1,241,168
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	1,866,158	971,212	1,832,630	975,681
8	うち、負債性有価証券の額	261,051	261,051	265,487	265,487
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		13,859		13,503
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	1,579,794	364,428	1,561,499	373,770
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	238,118	238,118	251,884	251,884
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	1,341,675	126,310	1,309,615	121,886
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	4,071	1,867	9,418	5,784
15	偶発事象に係る資金流出額	35,230	6,537	35,797	6,963
16	資金流出合計額		1,938,758		1,957,900
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	333,537	185,114	374,212	205,545
19	その他資金流入額	323,224	270,868	339,014	288,862
20	資金流入合計額	656,762	455,982	713,227	494,407
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		2,197,946		2,009,358
22	純資金流出額		1,482,776		1,463,492
23	単体流動性カバレッジ比率		148.2%		137.2%
24	平均値計算用データ数	61件		60件	

<流動性規制に関する開示>

(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1四半期)

(単位:百万円、%)

国際様式の 該当番号		2021年6月期	2021年3月期	2020年12月期	2020年9月期	2020年6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	2,197,946	2,009,358	1,954,197	2,085,241	2,001,708
16	純資金流出額	1,507,795	1,492,271	1,368,689	1,563,772	1,581,881
17	連結流動性カバレッジ比率	145.7%	134.6%	142.7%	133.3%	126.5%

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1四半期)

(単位:百万円、%)

国際様式の 該当番号		2021年6月期	2021年3月期	2020年12月期	2020年9月期	2020年6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	2,197,946	2,009,358	1,954,197	2,085,241	2,001,708
16	純資金流出額	1,482,776	1,463,492	1,345,290	1,542,731	1,559,910
17	単体流動性カバレッジ比率	148.2%	137.2%	145.2%	135.1%	128.3%