

<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2四半期)

(単位:百万円、%、件)

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	2,108,740		2,197,946	
<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	4,088,920	322,181	4,048,812	319,801
3	うち、安定預金の額	1,246,234	37,387	1,223,450	36,703
4	うち、準安定預金の額	2,842,472	284,794	2,825,207	283,098
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,955,042	1,068,425	2,141,320	1,246,374
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	1,695,441	808,824	1,881,255	986,309
8	うち、負債性有価証券の額	259,601	259,601	260,064	260,064
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		13,573		13,859
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	1,589,186	374,154	1,579,794	364,428
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	247,935	247,935	238,118	238,118
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	1,341,250	126,218	1,341,675	126,310
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	7,622	5,495	4,071	1,867
15	偶発事象に係る資金流出額	35,747	6,991	35,230	6,537
16	資金流出合計額		1,790,821		1,952,869
<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	337,558	181,800	322,632	174,208
19	その他資金流入額	298,544	268,285	323,221	270,864
20	資金流入合計額	636,103	450,085	645,853	445,073
<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		2,108,740		2,197,946
22	純資金流出額		1,340,735		1,507,795
23	連結流動性カバレッジ比率		157.2%		145.7%
24	平均値計算用データ数	61件		61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2四半期)

(単位:百万円、%、件)

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	2,108,740		2,197,946	
<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	4,088,920	322,181	4,048,812	319,801
3	うち、安定預金の額	1,246,234	37,387	1,223,450	36,703
4	うち、準安定預金の額	2,842,472	284,794	2,825,207	283,098
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,943,310	1,056,693	2,127,209	1,232,263
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	1,682,233	795,616	1,866,158	971,212
8	うち、負債性有価証券の額	261,076	261,076	261,051	261,051
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	-	13,573	-	13,859
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	1,589,186	374,154	1,579,794	364,428
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	247,935	247,935	238,118	238,118
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	1,341,250	126,218	1,341,675	126,310
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	7,622	5,495	4,071	1,867
15	偶発事象に係る資金流出額	35,747	6,991	35,230	6,537
16	資金流出合計額	-	1,779,089	-	1,938,758
<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	348,516	192,758	333,537	185,114
19	その他資金流入額	298,547	268,288	323,224	270,868
20	資金流入合計額	647,064	461,046	656,762	455,982
<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	-	2,108,740	-	2,197,946
22	純資金流出額	-	1,318,042	-	1,482,776
23	単体流動性カバレッジ比率	-	159.9%	-	148.2%
24	平均値計算用データ数	61件		61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2四半期)

(単位:百万円、%)

国際様式の 該当番号		2021年9月期	2021年6月期	2021年3月期	2020年12月期	2020年9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	2,108,740	2,197,946	2,009,358	1,954,197	2,085,241
16	純資金流出額	1,340,735	1,507,795	1,492,271	1,368,689	1,563,772
17	連結流動性カバレッジ比率	157.2%	145.7%	134.6%	142.7%	133.3%

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2四半期)

(単位:百万円、%)

国際様式の 該当番号		2021年9月期	2021年6月期	2021年3月期	2020年12月期	2020年9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	2,108,740	2,197,946	2,009,358	1,954,197	2,085,241
16	純資金流出額	1,318,042	1,482,776	1,463,492	1,345,290	1,542,731
17	単体流動性カバレッジ比率	159.9%	148.2%	137.2%	145.2%	135.1%