

<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3四半期)

(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	2,047,975		2,108,740	
<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	4,099,242	323,016	4,088,920	322,181
3	うち、安定預金の額	1,248,798	37,463	1,246,234	37,387
4	うち、準安定預金の額	2,850,214	285,552	2,842,472	284,794
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,831,586	947,629	1,955,042	1,068,425
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	1,566,977	683,019	1,695,441	808,824
8	うち、負債性有価証券の額	264,609	264,609	259,601	259,601
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	-	11,387	-	13,573
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	1,667,826	439,911	1,589,186	374,154
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	312,528	312,528	247,935	247,935
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	1,355,298	127,383	1,341,250	126,218
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	2,878	1,349	7,622	5,495
15	偶発事象に係る資金流出額	36,606	7,467	35,747	6,991
16	資金流出合計額	-	1,730,763	-	1,790,821
<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	312,901	169,837	337,558	181,800
19	その他資金流入額	346,169	325,915	298,544	268,285
20	資金流入合計額	659,070	495,752	636,103	450,085
<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	-	2,047,975	-	2,108,740
22	純資金流出額	-	1,235,010	-	1,340,735
23	連結流動性カバレッジ比率	-	165.8%	-	157.2%
24	平均値計算用データ数	63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3四半期)

(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	2,047,975		2,108,740	
<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	4,099,242	323,016	4,088,920	322,181
3	うち、安定預金の額	1,248,798	37,463	1,246,234	37,387
4	うち、準安定預金の額	2,850,214	285,552	2,842,472	284,794
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,820,804	936,846	1,943,310	1,056,693
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	1,555,237	671,280	1,682,233	795,616
8	うち、負債性有価証券の額	265,566	265,566	261,076	261,076
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		11,387		13,573
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	1,667,826	439,911	1,589,186	374,154
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	312,528	312,528	247,935	247,935
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	1,355,298	127,383	1,341,250	126,218
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	2,878	1,349	7,622	5,495
15	偶発事象に係る資金流出額	36,606	7,467	35,747	6,991
16	資金流出合計額		1,719,980		1,779,089
<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	323,747	180,684	348,516	192,758
19	その他資金流入額	346,172	325,918	298,547	268,288
20	資金流入合計額	669,920	506,602	647,064	461,046
<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		2,047,975		2,108,740
22	純資金流出額		1,213,378		1,318,042
23	単体流動性カバレッジ比率		168.7%		159.9%
24	平均値計算用データ数	63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3四半期)

(単位:百万円)

国際様式の 該当番号		2021年12月期	2021年9月期	2021年6月期	2021年3月期	2020年12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	2,047,975	2,108,740	2,197,946	2,009,358	1,954,197
16	純資金流出額	1,235,010	1,340,735	1,507,795	1,492,271	1,368,689
17	連結流動性カバレッジ比率	165.8%	157.2%	145.7%	134.6%	142.7%

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3四半期)

(単位:百万円)

国際様式の 該当番号		2021年12月期	2021年9月期	2021年6月期	2021年3月期	2020年12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	2,047,975	2,108,740	2,197,946	2,009,358	1,954,197
16	純資金流出額	1,213,378	1,318,042	1,482,776	1,463,492	1,345,290
17	単体流動性カバレッジ比率	168.7%	159.9%	148.2%	137.2%	145.2%