

# 〔経営の健全性の状況のうち、流動性に係る健全性を判断するための基準に係る事項<定量的開示事項>〕

## (流動性カバレッジ比率に関する定量的事項【連結】)

(単位：百万円、%、件)

項目		2021年3月期 第2四半期		2021年3月期 第1四半期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	2,085,241		2,001,708	
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	3,941,377	311,233	3,825,561	303,604
3	うち、安定預金の額	1,192,685	35,780	1,135,931	34,077
4	うち、準安定預金の額	2,748,677	275,453	2,689,591	269,526
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,116,825	1,334,543	2,108,233	1,343,594
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	1,853,465	1,071,183	1,823,131	1,058,492
8	うち、負債性有価証券の額	263,359	263,359	285,101	285,101
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		—		3,209
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	1,546,532	377,949	1,502,516	375,525
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	260,223	260,223	262,277	262,277
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	1,286,309	117,726	1,240,238	113,247
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	7,560	5,079	11,298	6,293
15	偶発事象に係る資金流出額	33,448	7,394	34,126	7,782
16	資金流出合計額		2,036,200		2,040,009
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	172,935	—	195,497	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	379,268	207,675	355,597	192,817
19	その他資金流入額	291,701	264,752	274,217	265,310
20	資金流入合計額	843,905	472,428	825,312	458,127
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		2,085,241		2,001,708
22	純資金流出額		1,563,772		1,581,881
23	連結流動性カバレッジ比率		133.3%		126.5%
24	平均値計算用データ数	61件		61件	

(流動性カバレッジ比率に関する定量的事項【単体】)

(単位：百万円、%、件)

項目		2021年3月期 第2四半期		2021年3月期 第1四半期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	2,085,241		2,001,708	
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	3,941,377	311,233	3,825,561	303,604
3	うち、安定預金の額	1,192,685	35,780	1,135,931	34,077
4	うち、準安定預金の額	2,748,677	275,453	2,689,591	269,526
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,106,974	1,324,693	2,097,320	1,332,681
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	1,842,224	1,059,943	1,811,405	1,046,766
8	うち、負債性有価証券の額	264,750	264,750	285,914	285,914
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		—		3,209
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	1,546,532	377,949	1,502,516	375,525
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	260,223	260,223	262,277	262,277
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	1,286,309	117,726	1,240,238	113,247
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	7,561	5,079	11,298	6,293
15	偶発事象に係る資金流出額	33,448	7,394	34,126	7,782
16	資金流出合計額		2,026,349		2,029,096
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	172,935	—	195,497	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	390,459	218,861	366,652	203,871
19	その他資金流入額	292,246	264,756	274,221	265,314
20	資金流入合計額	855,641	483,618	836,371	469,186
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		2,085,241		2,001,708
22	純資金流出額		1,542,731		1,559,910
23	単体流動性カバレッジ比率		135.1%		128.3%
24	平均値計算用データ数	61件		61件	