

[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4四半期		2021年3月期 第3四半期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	2,009,358		1,954,197	
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	4,015,210	316,710	3,964,077	313,288
3	うち、安定預金の額	1,221,121	36,633	1,196,573	35,897
4	うち、準安定預金の額	2,793,971	280,076	2,767,456	277,391
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,115,801	1,258,852	1,915,409	1,112,354
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	1,851,736	994,788	1,675,773	872,718
8	うち、負債性有価証券の額	264,064	264,064	239,636	239,636
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		13,503		6,697
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	1,561,499	373,770	1,547,317	357,885
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	251,884	251,884	236,649	236,649
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	1,309,615	121,886	1,310,668	121,235
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	9,418	5,783	6,999	5,135
15	偶発事象に係る資金流出額	35,797	6,963	33,713	7,284
16	資金流出合計額		1,975,583		1,802,645
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	—	—	3,834	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	363,116	194,453	330,321	177,780
19	その他資金流入額	339,011	288,858	292,165	256,175
20	資金流入合計額	702,127	483,312	626,320	433,955
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		2,009,358		1,954,197
22	純資金流出額		1,492,271		1,368,689
23	連結流動性カバレッジ比率		134.6%		142.7%
24	平均値計算用データ数	60件		63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4四半期		2021年3月期 第3四半期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	2,009,358		1,954,197	
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	4,015,210	316,710	3,964,077	313,288
3	うち、安定預金の額	1,221,121	36,633	1,196,573	35,897
4	うち、準安定預金の額	2,793,971	280,076	2,767,456	277,391
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,098,117	1,241,168	1,903,144	1,100,089
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	1,832,630	975,681	1,662,625	859,571
8	うち、負債性有価証券の額	265,487	265,487	240,518	240,518
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	—	13,503	—	6,697
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	1,561,499	373,770	1,547,317	357,885
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	251,884	251,884	236,649	236,649
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	1,309,615	121,886	1,310,668	121,235
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	9,418	5,784	6,999	5,135
15	偶発事象に係る資金流出額	35,797	6,963	33,713	7,284
16	資金流出合計額	—	1,957,900	—	1,790,380
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	—	—	3,834	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	374,212	205,545	341,452	188,910
19	その他資金流入額	339,014	288,862	292,168	256,179
20	資金流入合計額	713,227	494,407	637,455	445,089
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	—	2,009,358	—	1,954,197
22	純資金流出額	—	1,463,492	—	1,345,290
23	単体流動性カバレッジ比率	—	137.2%	—	145.2%
24	平均値計算用データ数	60件		63件	