

〈流動性カバレッジ比率に関する開示事項〉(2021年9月期 決算)

1. 連結流動性カバレッジ比率

(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	1,223,390		1,158,849	
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	2,960,139	222,615	2,919,578	220,861
3	うち、安定預金の額	1,057,790	31,736	1,025,223	30,759
4	うち、準安定預金の額	1,902,348	190,842	1,894,355	190,063
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,756,019	1,122,823	1,703,421	1,064,664
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	1,667,408	1,034,212	1,622,923	984,166
8	うち、負債性有価証券の額	88,610	88,610	80,497	80,497
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		15,015		73,656
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	41,635	39,887	61,791	51,829
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	39,677	39,677	50,552	50,552
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	1,957	210	11,238	1,276
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	95,209	83,530	111,895	85,567
15	偶発事象に係る資金流出額	558,190	16,539	567,662	16,832
16	資金流出合計額		1,500,412		1,513,412
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	92,459	92,459	82,459	82,459
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	819,382	737,839	879,182	794,239
19	その他資金流入額	119,815	107,211	136,444	118,467
20	資金流入合計額	1,031,656	937,510	1,098,086	995,165
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		1,223,390		1,158,849
22	純資金流出額		573,604		530,767
23	連結流動性カバレッジ比率		213.2		218.3
24	平均値計算用データ数	61		61	

上記は、平成27年金融庁告示第7号の別紙様式第2号に基づく開示事項です。

2. 単体流動性カバレッジ比率

(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	1,223,390		1,158,849	
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	2,960,139	222,615	2,919,578	220,861
3	うち、安定預金の額	1,057,790	31,736	1,025,223	30,759
4	うち、準安定預金の額	1,902,348	190,842	1,894,355	190,063
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,755,622	1,122,426	1,705,165	1,066,408
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	1,667,011	1,033,815	1,624,667	985,911
8	うち、負債性有価証券の額	88,610	88,610	80,497	80,497
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		15,015		73,656
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	41,635	39,887	61,791	51,829
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	39,677	39,677	50,552	50,552
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	1,957	210	11,238	1,276
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	93,314	81,635	110,388	84,060
15	偶発事象に係る資金流出額	556,272	16,483	559,735	16,589
16	資金流出合計額		1,498,065		1,513,406
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	92,459	92,459	82,459	82,459
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	822,017	740,539	880,607	796,323
19	その他資金流入額	119,813	107,209	136,447	118,470
20	資金流入合計額	1,034,289	940,207	1,099,513	997,252
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		1,223,390		1,158,849
22	純資金流出額		568,888		529,674
23	単体流動性カバレッジ比率		215.0		218.7
24	平均値計算用データ数	61		61	

上記は、平成27年金融庁告示第7号の別紙様式第1号に基づく開示事項です。