

〈流動性カバレッジ比率に関する開示事項〉(2022年6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	1,216,081		1,146,733	
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	3,036,278	226,844	3,014,600	225,274
3	うち、安定預金の額	1,104,970	33,152	1,097,233	32,920
4	うち、準安定預金の額	1,931,307	193,669	1,917,366	192,317
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,658,799	925,086	1,694,028	1,060,327
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	1,658,393	924,681	1,691,917	1,058,216
8	うち、負債性有価証券の額	405	405	2,111	2,111
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		22,223		16,943
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	68,313	55,494	54,167	42,072
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	53,562	53,562	40,228	40,228
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	14,751	1,932	13,938	1,843
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	135,166	112,058	151,588	137,842
15	偶発事象に係る資金流出額	558,816	16,553	560,260	16,590
16	資金流出合計額		1,358,262		1,499,051
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	105,836	105,836	105,152	105,152
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	782,876	713,360	907,766	821,450
19	その他資金流入額	140,056	125,961	105,564	93,744
20	資金流入合計額	1,028,769	945,158	1,118,484	1,020,348
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		1,216,081		1,146,733
22	純資金流出額		439,811		498,394
23	連結流動性カバレッジ比率		276.5		230.0
24	平均値計算用データ数	61		59	

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	1,216,081		1,146,733	
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	3,036,278	226,844	3,014,600	225,274
3	うち、安定預金の額	1,104,970	33,152	1,097,233	32,920
4	うち、準安定預金の額	1,931,307	193,669	1,917,366	192,317
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,661,082	927,369	1,695,888	1,062,186
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	1,660,676	926,963	1,693,777	1,060,075
8	うち、負債性有価証券の額	405	405	2,111	2,111
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		22,223		16,943
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	68,313	55,494	54,167	42,072
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	53,562	53,562	40,228	40,228
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	14,751	1,932	13,938	1,843
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	134,077	110,969	150,535	136,789
15	偶発事象に係る資金流出額	544,436	16,122	546,371	16,174
16	資金流出合計額		1,359,024		1,499,441
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	105,836	105,836	105,152	105,152
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	788,981	720,728	912,308	827,237
19	その他資金流入額	140,065	125,970	105,573	93,753
20	資金流入合計額	1,034,882	952,535	1,123,034	1,026,143
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		1,216,081		1,146,733
22	純資金流出額		435,908		494,606
23	単体流動性カバレッジ比率		278.9		231.8
24	平均値計算用データ数	61		59	

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。