

連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項(2022年3月期 第3四半期)

(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 | 1,812,764 | | 1,920,970 | |
| 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 | 2,731,319 | 264,527 | 2,717,100 | 262,742 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 139,971 | 4,199 | 145,484 | 4,364 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 2,591,347 | 260,328 | 2,571,615 | 258,377 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 2,066,454 | 832,779 | 2,137,681 | 864,420 |
| 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 | 1,908,384 | 674,708 | 1,977,365 | 704,104 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 158,070 | 158,070 | 160,315 | 160,315 |
| 9 | 有担保資金調達等に係る資金流出額 | | - | | - |
| 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 | 537,925 | 83,310 | 524,561 | 83,206 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 49,303 | 49,303 | 50,594 | 50,594 |
| 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 | 488,621 | 34,006 | 473,966 | 32,612 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 130,319 | 24,877 | 112,602 | 22,121 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 1,690,446 | 57,498 | 1,682,799 | 57,267 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 1,262,993 | | 1,289,758 |
| 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 | - | - | - | - |
| 18 | 貸付金等の回収に係る資金流入額 | 961,221 | 733,641 | 997,255 | 770,173 |
| 19 | その他資金流入額 | 85,500 | 60,562 | 90,427 | 72,486 |
| 20 | 資金流入合計額 | 1,046,722 | 794,203 | 1,087,682 | 842,659 |
| 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 | | 1,812,764 | | 1,920,970 |
| 22 | 純資金流出額 | | 469,098 | | 460,930 |
| 23 | 連結流動性カバレッジ比率 | | 386.4 | | 416.7 |
| 24 | 平均値計算用データ数 | 63 | | 61 | |