

連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項(2021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	2,199,681		2,102,880	
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	2,660,051	256,951	2,660,232	256,587
3	うち、安定預金の額	148,163	4,444	153,487	4,604
4	うち、準安定預金の額	2,511,887	252,506	2,506,744	251,983
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,107,221	838,727	3,313,518	1,335,317
6	うち、適格オペレーション預金の額	-	-	-	-
7	うち、適格オペレーション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	1,974,016	705,521	3,168,714	1,190,512
8	うち、負債性有価証券の額	133,205	133,205	144,804	144,804
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	510,917	88,312	487,791	75,143
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	57,787	57,787	45,628	45,628
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	453,129	30,525	442,162	29,514
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	160,146	29,103	183,556	27,350
15	偶発事象に係る資金流出額	1,627,107	63,758	1,592,701	62,717
16	資金流出合計額		1,276,852		1,757,117
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	906,904	665,856	703,661	431,321
19	その他資金流入額	58,405	51,295	91,883	80,120
20	資金流入合計額	965,309	717,152	795,545	511,442
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		2,199,681		2,102,880
22	純資金流出額		565,323		1,245,674
23	連結流動性カバレッジ比率		389.1		168.8
24	平均値計算用データ数	63		61	

- 連結流動性カバレッジ比率は389.1%であり、前四半期に比較し、220.3%上昇しております。
- この主要な要因は、ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額(資金流出率を乗じた後の額)が、前四半期と比較して、496,590百万円減少の838,727百万円となったことによります。
- ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額が減少した理由は、従来、「ホールセール無担保資金調達」の算出上、告示で定められる「基準日より30日を経過する日」までの期間に対応した金額について、システム仕様の制約のため、経過期間に関係なく全額算入しておりましたが、当四半期よりシステム仕様の見直しにより、「基準日より30日を経過する日」までの期間に対応した金額の算出ができるようになったことに伴い、算入額の範囲を見直したためであります。