

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（2023年3月期 第1四半期）

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	適格流動資産の合計額	2,145,885		2,202,343	
資金流出額		資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額	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	4,124,324	314,590	4,101,942	312,080
3	うち、安定預金の額	1,408,083	42,242	1,414,219	42,426
4	うち、準安定預金の額	2,716,241	272,348	2,687,722	269,653
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,364,249	601,081	1,351,362	642,598
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	1,350,803	587,635	1,343,576	634,812
8	うち、負債性有価証券の額	13,446	13,446	7,786	7,786
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		4,565		4,581
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	1,704,001	195,958	1,691,482	179,236
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	58,900	58,900	40,425	40,425
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	1,645,100	137,058	1,651,057	138,810
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	54,697	43,241	66,041	51,925
15	偶発事象に係る資金流出額	44,986	13,988	42,680	12,016
16	資金流出合計額		1,173,426		1,202,438
資金流入額		資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額	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	278,899	153,274	256,935	135,088
19	その他資金流入額	90,536	69,181	91,981	70,018
20	資金流入合計額	369,436	222,456	348,917	205,107
連結流動性カバレッジ比率					
21	算入可能適格流動資産の合計額		2,145,885		2,202,343
22	純資金流出額		950,970		997,331
23	連結流動性カバレッジ比率		225.6		220.8
24	平均値計算用データ数		61		59

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	適格流動資産の合計額	2,145,885		2,202,343	
資金流出額		資金流出率 を乗じる前 の額	資金流出率 を乗じた後 の額	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	4,124,324	314,590	4,101,942	312,080
3	うち、安定預金の額	1,408,083	42,242	1,414,219	42,426
4	うち、準安定預金の額	2,716,241	272,348	2,687,722	269,653
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,370,280	607,112	1,357,997	649,232
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	1,355,885	592,717	1,348,458	639,694
8	うち、負債性有価証券の額	14,394	14,394	9,538	9,538
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		4,565		4,581
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	1,695,047	199,432	1,682,316	182,732
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	58,900	58,900	40,425	40,425
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	1,636,147	140,532	1,641,890	142,306
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	34,035	22,579	45,600	31,483
15	偶発事象に係る資金流出額	44,977	13,979	42,675	12,012
16	資金流出合計額		1,162,259		1,192,123
資金流入額		資金流入率 を乗じる前 の額	資金流入率 を乗じた後 の額	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	282,027	156,403	260,400	138,552
19	その他資金流入額	90,536	69,181	91,984	70,022
20	資金流入合計額	372,564	225,584	352,385	208,574
単体流動性カバレッジ比率					
21	算入可能適格流動資産の合計額		2,145,885		2,202,343
22	純資金流出額		936,675		983,548
23	単体流動性カバレッジ比率		229.0		223.9
24	平均値計算用データ数	61		59	