

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 中間期）

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	1,473,831		2,145,885	
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	4,172,878	317,357	4,124,324	314,590
3	うち、安定預金の額	1,436,447	43,093	1,408,083	42,242
4	うち、準安定預金の額	2,736,430	274,264	2,716,241	272,348
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,144,724	415,385	1,364,249	601,081
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	1,139,982	410,643	1,350,803	587,635
8	うち、負債性有価証券の額	4,741	4,741	13,446	13,446
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		4,955		4,565
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	1,740,641	229,269	1,704,001	195,958
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	91,981	91,981	58,900	58,900
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	1,648,660	137,288	1,645,100	137,058
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	34,558	29,397	54,697	43,241
15	偶発事象に係る資金流出額	47,577	16,693	44,986	13,988
16	資金流出合計額		1,013,059		1,173,426
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	301,270	176,476	278,899	153,274
19	その他資金流入額	104,776	85,798	90,536	69,181
20	資金流入合計額	406,046	262,274	369,436	222,456
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		1,473,831		2,145,885
22	純資金流出額		750,785		950,970
23	連結流動性カバレッジ比率		196.3		225.6
24	平均値計算用データ数		62		61

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	1,473,831		2,145,885	
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	4,172,878	317,357	4,124,324	314,590
3	うち、安定預金の額	1,436,447	43,093	1,408,083	42,242
4	うち、準安定預金の額	2,736,430	274,264	2,716,241	272,348
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,150,980	421,641	1,370,280	607,112
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	1,145,223	415,883	1,355,885	592,717
8	うち、負債性有価証券の額	5,757	5,757	14,394	14,394
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		4,955		4,565
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	1,732,318	232,883	1,695,047	199,432
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	91,981	91,981	58,900	58,900
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	1,640,336	140,902	1,636,147	140,532
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	14,272	9,112	34,035	22,579
15	偶発事象に係る資金流出額	47,566	16,683	44,977	13,979
16	資金流出合計額		1,002,633		1,162,259
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	304,838	180,044	282,027	156,403
19	その他資金流入額	104,778	85,800	90,536	69,181
20	資金流入合計額	409,616	265,844	372,564	225,584
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		1,473,831		2,145,885
22	純資金流出額		736,788		936,675
23	単体流動性カバレッジ比率		200.0		229.0
24	平均値計算用データ数	62		61	