

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3四半期）

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	1,308,318		1,473,831	
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	4,182,650	318,982	4,172,878	317,357
3	うち、安定預金の額	1,426,316	42,789	1,436,447	43,093
4	うち、準安定預金の額	2,756,333	276,192	2,736,430	274,264
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,155,111	436,651	1,144,724	415,385
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	1,149,017	430,557	1,139,982	410,643
8	うち、負債性有価証券の額	6,093	6,093	4,741	4,741
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		5,450		4,955
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	1,727,030	229,050	1,740,641	229,269
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	91,789	91,789	91,981	91,981
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	1,635,240	137,261	1,648,660	137,288
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	34,133	28,958	34,558	29,397
15	偶発事象に係る資金流出額	47,516	18,445	47,577	16,693
16	資金流出合計額		1,037,538		1,013,059
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	265,253	144,482	301,270	176,476
19	その他資金流入額	107,607	90,554	104,776	85,798
20	資金流入合計額	372,861	235,037	406,046	262,274
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		1,308,318		1,473,831
22	純資金流出額		802,500		750,785
23	連結流動性カバレッジ比率		163.0		196.3
24	平均値計算用データ数		62		62

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	1,308,318		1,473,831	
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	4,182,650	318,982	4,172,878	317,357
3	うち、安定預金の額	1,426,316	42,789	1,436,447	43,093
4	うち、準安定預金の額	2,756,333	276,192	2,736,430	274,264
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,161,225	442,765	1,150,980	421,641
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	1,154,255	435,795	1,145,223	415,883
8	うち、負債性有価証券の額	6,970	6,970	5,757	5,757
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		5,450		4,955
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	1,719,824	233,004	1,732,318	232,883
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	91,789	91,789	91,981	91,981
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	1,628,035	141,215	1,640,336	140,902
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	14,001	8,826	14,272	9,112
15	偶発事象に係る資金流出額	47,505	18,433	47,566	16,683
16	資金流出合計額		1,027,463		1,002,633
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	267,955	147,184	304,838	180,044
19	その他資金流入額	107,607	90,554	104,778	85,800
20	資金流入合計額	375,562	237,739	409,616	265,844
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		1,308,318		1,473,831
22	純資金流出額		789,724		736,788
23	単体流動性カバレッジ比率		165.6		200.0
24	平均値計算用データ数	62		62	