

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）

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	1,349,738		1,308,318	
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	4,208,098	319,851	4,182,650	318,982
3	うち、安定預金の額	1,449,035	43,471	1,426,316	42,789
4	うち、準安定預金の額	2,759,062	276,379	2,756,333	276,192
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,261,718	537,239	1,155,111	436,651
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	1,255,024	530,546	1,149,017	430,557
8	うち、負債性有価証券の額	6,693	6,693	6,093	6,093
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		2,560		5,450
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	1,701,696	226,312	1,727,030	229,050
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	91,792	91,792	91,789	91,789
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	1,609,903	134,520	1,635,240	137,261
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	37,263	34,281	34,133	28,958
15	偶発事象に係る資金流出額	47,263	19,137	47,516	18,445
16	資金流出合計額		1,139,383		1,037,538
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	280,699	149,989	265,253	144,482
19	その他資金流入額	105,976	89,521	107,607	90,554
20	資金流入合計額	386,675	239,510	372,861	235,037
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		1,349,738		1,308,318
22	純資金流出額		899,872		802,500
23	連結流動性カバレッジ比率		149.9		163.0
24	平均値計算用データ数		60		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	1,349,738		1,308,318	
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	4,208,098	319,851	4,182,650	318,982
3	うち、安定預金の額	1,449,035	43,471	1,426,316	42,789
4	うち、準安定預金の額	2,759,062	276,379	2,756,333	276,192
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,268,284	543,805	1,161,225	442,765
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	1,259,890	535,411	1,154,255	435,795
8	うち、負債性有価証券の額	8,393	8,393	6,970	6,970
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		2,560		5,450
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	1,694,778	230,287	1,719,824	233,004
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	91,792	91,792	91,789	91,789
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	1,602,985	138,494	1,628,035	141,215
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	15,874	12,892	14,001	8,826
15	偶発事象に係る資金流出額	47,251	19,125	47,505	18,433
16	資金流出合計額		1,128,522		1,027,463
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	283,912	153,202	267,955	147,184
19	その他資金流入額	105,979	89,523	107,607	90,554
20	資金流入合計額	389,891	242,726	375,562	237,739
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		1,349,738		1,308,318
22	純資金流出額		885,795		789,724
23	単体流動性カバレッジ比率		152.3		165.6
24	平均値計算用データ数		60		62