

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（2024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	1,440,689		1,349,738	
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	4,208,660	320,760	4,208,098	319,851
3	うち、安定預金の額	1,436,694	43,100	1,449,035	43,471
4	うち、準安定預金の額	2,771,966	277,659	2,759,062	276,379
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,337,659	568,740	1,261,718	537,239
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	1,327,959	559,040	1,255,024	530,546
8	うち、負債性有価証券の額	9,700	9,700	6,693	6,693
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		2,536		2,560
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	1,704,871	213,986	1,701,696	226,312
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	77,927	77,927	91,792	91,792
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	1,626,943	136,059	1,609,903	134,520
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	50,372	37,776	37,263	34,281
15	偶発事象に係る資金流出額	49,170	21,464	47,263	19,137
16	資金流出合計額		1,165,266		1,139,383
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	267,058	142,042	280,699	149,989
19	その他資金流入額	86,940	74,684	105,976	89,521
20	資金流入合計額	353,998	216,727	386,675	239,510
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		1,440,689		1,349,738
22	純資金流出額		948,538		899,872
23	連結流動性カバレッジ比率		151.8		149.9
24	平均値計算用データ数		62		60

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	1,440,689		1,349,738	
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	4,208,660	320,760	4,208,098	319,851
3	うち、安定預金の額	1,436,694	43,100	1,449,035	43,471
4	うち、準安定預金の額	2,771,966	277,659	2,759,062	276,379
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,343,056	574,137	1,268,284	543,805
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	1,332,386	563,467	1,259,890	535,411
8	うち、負債性有価証券の額	10,669	10,669	8,393	8,393
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		2,536		2,560
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	1,698,590	218,070	1,694,778	230,287
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	77,927	77,927	91,792	91,792
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	1,620,663	140,143	1,602,985	138,494
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	30,078	17,483	15,874	12,892
15	偶発事象に係る資金流出額	49,159	21,453	47,251	19,125
16	資金流出合計額		1,154,442		1,128,522
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	269,823	144,808	283,912	153,202
19	その他資金流入額	86,940	74,684	105,979	89,523
20	資金流入合計額	356,763	219,493	389,891	242,726
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		1,440,689		1,349,738
22	純資金流出額		934,949		885,795
23	単体流動性カバレッジ比率		154.0		152.3
24	平均値計算用データ数		62		60