

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	1,722,044		1,635,399	
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	4,252,374	323,512	4,248,361	322,614
3	うち、安定預金の額	1,459,075	43,772	1,466,628	43,998
4	うち、準安定預金の額	2,793,298	279,740	2,781,732	278,615
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,565,767	834,500	1,455,831	715,315
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	1,561,540	830,272	1,451,831	711,315
8	うち、負債性有価証券の額	4,227	4,227	4,000	4,000
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		3,558		3,823
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	1,671,439	206,803	1,699,572	220,389
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	74,200	74,200	85,485	85,485
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	1,597,238	132,603	1,614,087	134,904
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	55,405	50,232	42,633	38,178
15	偶発事象に係る資金流出額	55,582	24,605	53,602	24,105
16	資金流出合計額		1,443,212		1,324,427
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	293,636	158,874	288,125	156,691
19	その他資金流入額	93,815	82,267	98,424	85,601
20	資金流入合計額	387,451	241,142	386,550	242,292
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		1,722,044		1,635,399
22	純資金流出額		1,202,070		1,082,134
23	連結流動性カバレッジ比率		143.2		151.1
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	1,722,044		1,635,399	
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	4,252,374	323,512	4,248,361	322,614
3	うち、安定預金の額	1,459,075	43,772	1,466,628	43,998
4	うち、準安定預金の額	2,793,298	279,740	2,781,732	278,615
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,572,275	841,007	1,462,037	721,522
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	1,567,096	835,828	1,457,136	716,620
8	うち、負債性有価証券の額	5,179	5,179	4,901	4,901
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		3,558		3,823
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	1,662,603	209,617	1,693,430	224,387
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	74,200	74,200	85,485	85,485
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	1,588,402	135,416	1,607,945	138,902
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	35,753	30,580	22,894	18,439
15	偶発事象に係る資金流出額	55,563	24,585	53,585	24,088
16	資金流出合計額		1,432,861		1,314,875
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	299,054	164,292	291,654	160,219
19	その他資金流入額	93,815	82,267	98,427	85,604
20	資金流入合計額	392,869	246,560	390,081	245,824
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		1,722,044		1,635,399
22	純資金流出額		1,186,301		1,069,051
23	単体流動性カバレッジ比率		145.1		152.9
24	平均値計算用データ数	62		62	