

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）

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	1,777,935		1,722,044	
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	4,284,598	324,584	4,252,374	323,512
3	うち、安定預金の額	1,489,233	44,676	1,459,075	43,772
4	うち、準安定預金の額	2,795,365	279,907	2,793,298	279,740
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,667,005	925,558	1,565,767	834,500
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	1,663,624	922,177	1,561,540	830,272
8	うち、負債性有価証券の額	3,380	3,380	4,227	4,227
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		2,550		3,558
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	1,652,417	200,213	1,671,439	206,803
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	69,327	69,327	74,200	74,200
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	1,583,089	130,885	1,597,238	132,603
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	82,711	76,043	55,405	50,232
15	偶発事象に係る資金流出額	60,671	31,454	55,582	24,605
16	資金流出合計額		1,560,405		1,443,212
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	323,179	171,981	293,636	158,874
19	その他資金流入額	120,373	107,303	93,815	82,267
20	資金流入合計額	443,553	279,284	387,451	241,142
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		1,777,935		1,722,044
22	純資金流出額		1,281,120		1,202,070
23	連結流動性カバレッジ比率		138.7		143.2
24	平均値計算用データ数		58		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	1,777,935		1,722,044	
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	4,284,598	324,584	4,252,374	323,512
3	うち、安定預金の額	1,489,233	44,676	1,459,075	43,772
4	うち、準安定預金の額	2,795,365	279,907	2,793,298	279,740
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,673,653	932,207	1,572,275	841,007
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	1,668,550	927,103	1,567,096	835,828
8	うち、負債性有価証券の額	5,103	5,103	5,179	5,179
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		2,550		3,558
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	1,643,476	202,891	1,662,603	209,617
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	69,327	69,327	74,200	74,200
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	1,574,148	133,563	1,588,402	135,416
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	62,127	55,459	35,753	30,580
15	偶発事象に係る資金流出額	60,651	31,434	55,563	24,585
16	資金流出合計額		1,549,128		1,432,861
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	330,150	178,952	299,054	164,292
19	その他資金流入額	120,376	107,306	93,815	82,267
20	資金流入合計額	450,526	286,258	392,869	246,560
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		1,777,935		1,722,044
22	純資金流出額		1,262,870		1,186,301
23	単体流動性カバレッジ比率		140.7		145.1
24	平均値計算用データ数		58		62