

Ⅲ. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

1. 連結流動性カバレッジ比率

(単位：百万円、%、件)

項 目		2023年3月期		2022年12月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	2,246,521		2,486,097	
資金流出額 (2)		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	5,519,206	458,213	5,499,237	456,966
3	うち、安定預金の額	1,344,442	40,333	1,334,498	40,034
4	うち、準安定預金の額	4,174,763	417,880	4,164,739	416,931
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,128,483	855,520	2,165,449	887,313
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	2,047,975	775,012	2,096,082	817,946
8	うち、負債性有価証券の額	80,508	80,508	69,367	69,367
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		8,153		7,647
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	142,724	46,297	133,012	36,373
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	32,422	32,422	22,298	22,298
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	110,302	13,875	110,714	14,075
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	47,642	40,988	43,365	38,207
15	偶発事象に係る資金流出額	1,235,113	31,763	1,261,278	33,173
16	資金流出合計額		1,440,936		1,459,681
資金流入額 (3)		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	287,173	155,427	257,253	140,520
19	その他資金流入額	43,258	15,220	43,736	19,240
20	資金流入合計額	330,431	170,647	300,989	159,760
連結流動性カバレッジ比率 (4)					
21	算入可能適格流動資産の合計額		2,246,521		2,486,097
22	純資金流出額		1,270,288		1,299,921
23	連結流動性カバレッジ比率		176.8%		191.2%
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		2023年3月期		2022年12月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	2,246,521		2,486,097	
資金流出額 (2)		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	5,519,206	458,213	5,499,237	456,966
3	うち、安定預金の額	1,344,442	40,333	1,334,498	40,034
4	うち、準安定預金の額	4,174,763	417,880	4,164,739	416,931
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,139,208	866,245	2,176,812	898,676
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	2,056,060	783,097	2,105,424	827,287
8	うち、負債性有価証券の額	83,148	83,148	71,388	71,388
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		8,153		7,647
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	142,724	46,297	133,012	36,373
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	32,422	32,422	22,298	22,298
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	110,302	13,875	110,714	14,075
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	22,164	15,510	18,299	13,141
15	偶発事象に係る資金流出額	1,249,838	31,763	1,276,014	33,173
16	資金流出合計額		1,426,184		1,445,978
資金流入額 (3)		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	300,576	168,830	270,702	153,969
19	その他資金流入額	43,280	15,242	43,757	19,261
20	資金流入合計額	343,856	184,073	314,459	173,230
単体流動性カバレッジ比率 (4)					
21	算入可能適格流動資産の合計額		2,246,521		2,486,097
22	純資金流出額		1,242,110		1,272,748
23	単体流動性カバレッジ比率		180.8%		195.3%
24	平均値計算用データ数		60		62