

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		2024年3月期		2023年12月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	2,782,914		2,836,860	
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	5,648,518	468,263	5,593,336	463,714
3	うち、安定預金の額	1,385,302	41,559	1,371,778	41,153
4	うち、準安定預金の額	4,263,216	426,704	4,221,558	422,560
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,493,305	1,176,428	2,484,497	1,172,395
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	2,413,235	1,096,358	2,422,892	1,110,790
8	うち、負債性有価証券の額	80,069	80,069	61,605	61,605
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	748		687	
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	157,937	51,296	148,761	47,798
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	36,019	36,019	33,336	33,336
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	121,918	15,277	115,425	14,462
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	37,411	33,514	39,043	36,338
15	偶発事象に係る資金流出額	1,244,823	40,001	1,248,794	39,168
16	資金流出合計額	1,770,251		1,760,103	
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	313,520	175,280	283,758	152,684
19	その他資金流入額	38,528	15,223	48,040	24,310
20	資金流入合計額	352,048	190,504	331,798	176,995
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	2,782,914		2,836,860	
22	純資金流出額	1,579,747		1,583,107	
23	連結流動性カバレッジ比率	176.1%		179.1%	
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		2024年3月期		2023年12月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	2,782,914		2,836,860	
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	5,648,518	468,263	5,593,336	463,714
3	うち、安定預金の額	1,385,302	41,559	1,371,778	41,153
4	うち、準安定預金の額	4,263,216	426,704	4,221,558	422,560
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,505,746	1,188,868	2,496,060	1,183,958
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	2,422,971	1,106,094	2,432,403	1,120,301
8	うち、負債性有価証券の額	82,774	82,774	63,656	63,656
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	748		687	
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	157,937	51,296	148,761	47,798
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	36,019	36,019	33,336	33,336
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	121,918	15,277	115,425	14,462
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	8,514	4,616	10,090	7,385
15	偶発事象に係る資金流出額	1,259,469	40,001	1,263,516	39,168
16	資金流出合計額	1,753,794		1,742,713	
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	328,445	190,205	297,753	166,679
19	その他資金流入額	38,554	15,250	48,065	24,335
20	資金流入合計額	366,999	205,456	345,818	191,014
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	2,782,914		2,836,860	
22	純資金流出額	1,548,338		1,551,698	
23	単体流動性カバレッジ比率	179.7%		182.8%	
24	平均値計算用データ数	58		62	