

**単体流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項**  
(2023年3月期)

(別紙様式第三号)

(単位：百万円、%、件)

| 項目                      |                                                 | 当四半期         |              | 前四半期         |              |
|-------------------------|-------------------------------------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| <b>適格流動資産 (1)</b>       |                                                 |              |              |              |              |
| 1                       | 適格流動資産の合計額                                      | 2,246,521    |              | 2,486,097    |              |
| <b>資金流出額 (2)</b>        |                                                 | 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    |              |
| <b>資金流入額 (3)</b>        |                                                 | 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      |
| <b>単体流動性カバレッジ比率 (4)</b> |                                                 |              |              |              |              |
| 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           |              |