

<流動性比率規制に関する開示>

連結流動性カバレッジ比率に関する定量的事項(2023年3月期 第1四半期)

(単位:百万円)

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	2,119,310		2,044,276	
<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	4,152,509	326,772	4,129,669	324,603
3	うち、安定預金の額	1,270,005	38,100	1,269,432	38,082
4	うち、準安定預金の額	2,882,033	288,672	2,859,881	286,520
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,086,356	1,137,924	1,971,226	1,061,036
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	1,812,527	864,095	1,700,271	790,082
8	うち、負債性有価証券の額	273,828	273,828	270,954	270,954
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	-	-	-	-
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	1,819,525	583,307	1,709,070	479,537
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	454,812	454,812	351,681	351,681
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	1,364,713	128,495	1,357,388	127,855
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	15,736	8,062	19,647	15,739
15	偶発事象に係る資金流出額	37,148	8,211	37,708	8,721
16	資金流出合計額	2,064,279		1,889,639	
<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	325,230	175,264	349,117	187,319
19	その他資金流入額	491,168	459,712	405,116	350,781
20	資金流入合計額	816,399	634,977	754,234	538,100
<b>連結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	2,119,310		2,044,276	
22	純資金流出額	1,429,302		1,351,538	
23	連結流動性カバレッジ比率	148.2%		151.2%	
24	平均値計算用データ数	61件		59件	

<流動性比率規制に関する開示>

単体流動性カバレッジ比率に関する定量的事項(2023年3月期 第1四半期)

(単位:百万円)

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	2,119,310		2,044,276	
<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	4,152,509	326,772	4,129,669	324,603
3	うち、安定預金の額	1,270,005	38,100	1,269,432	38,082
4	うち、準安定預金の額	2,882,033	288,672	2,859,881	286,520
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,077,168	1,128,736	1,960,661	1,050,471
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	1,802,257	853,825	1,688,232	778,043
8	うち、負債性有価証券の額	274,910	274,910	272,428	272,428
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	-	-	-	-
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	1,819,525	583,307	1,709,070	479,537
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	454,812	454,812	351,681	351,681
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	1,364,713	128,495	1,357,388	127,855
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	15,736	8,062	19,647	15,739
15	偶発事象に係る資金流出額	37,148	8,211	37,708	8,721
16	資金流出合計額	2,055,091		1,879,074	
<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	336,167	186,202	359,951	198,153
19	その他資金流入額	491,171	459,715	405,119	350,784
20	資金流入合計額	827,339	645,917	765,071	548,937
<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	2,119,310		2,044,276	
22	純資金流出額	1,409,174		1,330,136	
23	単体流動性カバレッジ比率	150.3%		153.6%	
24	平均値計算用データ数	61件		59件	

<流動性比率規制に関する開示>

(KM1 主要な指標)

連結流動性カバレッジ比率に関する定量的事項(2023年3月期 第1四半期)

(単位:百万円)

国際様式の 該当番号		2022年6月期	2022年3月期	2021年12月期	2021年9月期	2021年6月期
連結流動性カバレッジ比率						
15	算入可能適格流動性資産の合計額	2,119,310	2,044,276	2,047,975	2,108,740	2,197,946
16	純資金流出額	1,429,302	1,351,538	1,235,010	1,340,735	1,507,795
17	連結流動性カバレッジ比率	148.2%	151.2%	165.8%	157.2%	145.7%

単体流動性カバレッジ比率に関する定量的事項(2023年3月期 第1四半期)

(単位:百万円)

国際様式の 該当番号		2022年6月期	2022年3月期	2021年12月期	2021年9月期	2021年6月期
単体流動性カバレッジ比率						
15	算入可能適格流動性資産の合計額	2,119,310	2,044,276	2,047,975	2,108,740	2,197,946
16	純資金流出額	1,409,174	1,330,136	1,213,378	1,318,042	1,482,776
17	単体流動性カバレッジ比率	150.3%	153.6%	168.7%	159.9%	148.2%