

<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2四半期)

(単位:百万円)

項目		当四半期		前四半期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,976,851		2,119,310	
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	4,188,163	328,728	4,152,509	326,772
3	うち、安定預金の額	1,292,599	38,777	1,270,005	38,100
4	うち、準安定預金の額	2,895,105	289,950	2,882,033	288,672
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,990,760	1,055,777	2,086,356	1,137,924
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	1,741,905	806,921	1,812,527	864,095
8	うち、負債性有価証券の額	248,855	248,855	273,828	273,828
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		2,040		-
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	1,742,215	523,768	1,819,525	583,307
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	396,651	396,651	454,812	454,812
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	1,345,563	127,117	1,364,713	128,495
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	4,947	3,274	15,736	8,062
15	偶発事象に係る資金流出額	37,579	8,060	37,148	8,211
16	資金流出合計額		1,921,650		2,064,279
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	356,308	200,287	325,230	175,264
19	その他資金流入額	408,580	368,059	491,168	459,712
20	資金流入合計額	764,888	568,346	816,399	634,977
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		1,976,851		2,119,310
22	純資金流出額		1,353,303		1,429,302
23	連結流動性カバレッジ比率		146.0%		148.2%
24	平均値計算用データ数	62件		61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2四半期)

(単位:百万円)

項目		当四半期		前四半期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,976,851		2,119,310	
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	4,188,163	328,728	4,152,509	326,772
3	うち、安定預金の額	1,292,599	38,777	1,270,005	38,100
4	うち、準安定預金の額	2,895,105	289,950	2,882,033	288,672
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,981,572	1,046,589	2,077,168	1,128,736
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	1,731,217	796,234	1,802,257	853,825
8	うち、負債性有価証券の額	250,355	250,355	274,910	274,910
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		2,040		-
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	1,742,215	523,768	1,819,525	583,307
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	396,651	396,651	454,812	454,812
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	1,345,563	127,117	1,364,713	128,495
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	4,947	3,274	15,736	8,062
15	偶発事象に係る資金流出額	37,579	8,060	37,148	8,211
16	資金流出合計額		1,912,462		2,055,091
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	367,091	211,071	336,167	186,202
19	その他資金流入額	408,583	368,061	491,171	459,715
20	資金流入合計額	775,675	579,133	827,339	645,917
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		1,976,851		2,119,310
22	純資金流出額		1,333,329		1,409,174
23	単体流動性カバレッジ比率		148.2%		150.3%
24	平均値計算用データ数	62件		61件	

<流動性比率規制に関する開示>

(KM1 主要な指標)

(単位:百万円)

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2四半期)

(単位:百万円)

国際様式の 該当番号		2022年9月期	2022年6月期	2022年3月期	2021年12月期	2021年9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	1,976,851	2,119,310	2,044,276	2,047,975	2,108,740
16	純資金流出額	1,353,303	1,429,302	1,351,538	1,235,010	1,340,735
17	連結流動性カバレッジ比率	146.0%	148.2%	151.2%	165.8%	157.2%

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2四半期)

(単位:百万円)

国際様式の 該当番号		2022年9月期	2022年6月期	2022年3月期	2021年12月期	2021年9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	1,976,851	2,119,310	2,044,276	2,047,975	2,108,740
16	純資金流出額	1,333,329	1,409,174	1,330,136	1,213,378	1,318,042
17	単体流動性カバレッジ比率	148.2%	150.3%	153.6%	168.7%	159.9%