

<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3四半期)

(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	1,821,692		-	
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	4,188,939	328,981	-	-
3	うち、安定預金の額	1,289,781	38,693	-	-
4	うち、準安定預金の額	2,898,631	290,288	-	-
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,891,057	956,973	-	-
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	1,645,476	711,392	-	-
8	うち、負債性有価証券の額	245,581	245,581	-	-
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	-	6,442	-	-
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	1,697,916	497,281	-	-
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	377,916	377,916	-	-
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	1,320,000	119,364	-	-
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	10,565	5,945	-	-
15	偶発事象に係る資金流出額	38,046	7,865	-	-
16	資金流出合計額	-	1,803,489	-	-
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	371,843	212,435	-	-
19	その他資金流入額	353,532	327,411	-	-
20	資金流入合計額	725,376	539,847	-	-
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	-	1,821,692	-	-
22	純資金流出額	-	1,263,642	-	-
23	連結流動性カバレッジ比率	-	144.1%	-	-
24	平均値計算用データ数	62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3四半期)

(単位:百万円)

国際様式の 該当番号		2022年12月期	2022年9月期	2022年6月期	2022年3月期	2021年12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	1,821,692				
16	純資金流出額	1,263,642				
17	連結流動性カバレッジ比率	144.1%				

<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3四半期)

(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	1,821,692		1,976,851	
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	4,189,265	329,014	4,188,163	328,728
3	うち、安定預金の額	1,289,781	38,693	1,292,599	38,777
4	うち、準安定預金の額	2,898,958	290,320	2,895,105	289,950
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,890,195	956,030	1,990,760	1,055,777
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	1,643,520	709,355	1,741,905	806,921
8	うち、負債性有価証券の額	246,674	246,674	248,855	248,855
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		6,442		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	1,715,403	504,360	1,742,215	523,768
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	378,073	378,073	396,651	396,651
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	1,337,330	126,287	1,345,563	127,117
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	10,565	5,945	4,947	3,274
15	偶発事象に係る資金流出額	38,046	7,865	37,579	8,060
16	資金流出合計額		1,809,659		1,921,650
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	383,017	223,609	356,308	200,287
19	その他資金流入額	353,689	327,568	408,580	368,059
20	資金流入合計額	736,706	551,177	764,888	568,346
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		1,821,692		1,976,851
22	純資金流出額		1,258,481		1,353,303
23	連結流動性カバレッジ比率		144.7%		146.0%
24	平均値計算用データ数	62件		62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3四半期)

(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	1,821,692		1,976,851	
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	4,189,265	329,014	4,188,163	328,728
3	うち、安定預金の額	1,289,781	38,693	1,292,599	38,777
4	うち、準安定預金の額	2,898,958	290,320	2,895,105	289,950
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,883,484	949,319	1,981,572	1,046,589
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	1,636,809	702,644	1,731,217	796,234
8	うち、負債性有価証券の額	246,674	246,674	250,355	250,355
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	-	6,442	-	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	1,715,403	504,360	1,742,215	523,768
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	378,073	378,073	396,651	396,651
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	1,337,330	126,287	1,345,563	127,117
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	10,565	5,945	4,947	3,274
15	偶発事象に係る資金流出額	38,046	7,865	37,579	8,060
16	資金流出合計額	1,802,948		1,912,462	
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	383,017	223,609	367,091	211,071
19	その他資金流入額	353,689	327,568	408,583	368,061
20	資金流入合計額	736,706	551,177	775,675	579,133
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	1,821,692		1,976,851	
22	純資金流出額	1,251,770		1,333,329	
23	単体流動性カバレッジ比率	145.5%		148.2%	
24	平均値計算用データ数	62件		62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3四半期)

(単位:百万円)

国際様式の 該当番号		2022年12月期	2022年9月期	2022年6月期	2022年3月期	2021年12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	1,821,692	1,976,851	2,119,310	2,044,276	2,047,975
16	純資金流出額	1,258,481	1,353,303	1,429,302	1,351,538	1,235,010
17	連結流動性カバレッジ比率	144.7%	146.0%	148.2%	151.2%	165.8%

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3四半期)

(単位:百万円)

国際様式の 該当番号		2022年12月期	2022年9月期	2022年6月期	2022年3月期	2021年12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	1,821,692	1,976,851	2,119,310	2,044,276	2,047,975
16	純資金流出額	1,251,770	1,333,329	1,409,174	1,330,136	1,213,378
17	単体流動性カバレッジ比率	145.5%	148.2%	150.3%	153.6%	168.7%