

<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4四半期)

(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	1,762,847		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	4,208,247	330,094	4,188,939	328,981
3	うち、安定預金の額	1,301,709	39,051	1,289,781	38,693
4	うち、準安定預金の額	2,906,514	291,043	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	1,872,100	939,640	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	1,615,821	683,361	1,645,476	711,392
8	うち、負債性有価証券の額	256,278	256,278	245,581	245,581
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		11,575		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	1,803,838	574,924	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	451,756	451,756	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	1,352,081	123,167	1,320,000	119,364
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	7,840	3,061	10,565	5,945
15	偶発事象に係る資金流出額	39,171	7,265	38,046	7,865
16	資金流出合計額		1,866,562		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	11,686	-	-	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	421,516	234,644	371,843	212,435
19	その他資金流入額	428,465	410,186	353,532	327,411
20	資金流入合計額	861,669	644,831	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		1,762,847		1,821,692
22	純資金流出額		1,221,731		1,263,642
23	連結流動性カバレッジ比率		144.2%		144.1%
24	平均値計算用データ数	60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4四半期)

(単位:百万円)

国際様式の 該当番号		2023年3月期	2022年12月期	2022年9月期	2022年6月期	2022年3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	1,762,847	1,821,692			
16	純資金流出額	1,221,731	1,263,642			
17	連結流動性カバレッジ比率	144.2%	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4四半期)

(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	1,762,847		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	4,208,442	330,114	4,189,265	329,014
3	うち、安定預金の額	1,301,709	39,051	1,289,781	38,693
4	うち、準安定預金の額	2,906,709	291,062	2,898,958	290,320
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,873,642	941,039	1,890,195	956,030
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	1,615,680	683,078	1,643,520	709,355
8	うち、負債性有価証券の額	257,961	257,961	246,674	246,674
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		11,575		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	1,821,244	581,923	1,715,403	504,360
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	451,832	451,832	378,073	378,073
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	1,369,411	130,090	1,337,330	126,287
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	7,840	3,061	10,565	5,945
15	偶発事象に係る資金流出額	39,171	7,265	38,046	7,865
16	資金流出合計額		1,874,980		1,809,659
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	11,686	-	-	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	432,682	245,810	383,017	223,609
19	その他資金流入額	428,541	410,262	353,689	327,568
20	資金流入合計額	872,910	656,072	736,706	551,177
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		1,762,847		1,821,692
22	純資金流出額		1,218,907		1,258,481
23	連結流動性カバレッジ比率		144.6%		144.7%
24	平均値計算用データ数	60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4四半期)

(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	1,762,847		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	4,208,442	330,114	4,189,265	329,014
3	うち、安定預金の額	1,301,709	39,051	1,289,781	38,693
4	うち、準安定預金の額	2,906,709	291,062	2,898,958	290,320
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,873,847	941,245	1,883,484	949,319
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	1,615,885	683,283	1,636,809	702,644
8	うち、負債性有価証券の額	257,961	257,961	246,674	246,674
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		11,575		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	1,821,244	581,923	1,715,403	504,360
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	451,832	451,832	378,073	378,073
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	1,369,411	130,090	1,337,330	126,287
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	7,840	3,061	10,565	5,945
15	偶発事象に係る資金流出額	39,171	7,265	38,046	7,865
16	資金流出合計額		1,875,185		1,802,948
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	11,686	-	-	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	432,682	245,810	383,017	223,609
19	その他資金流入額	428,541	410,262	353,689	327,568
20	資金流入合計額	872,910	656,072	736,706	551,177
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		1,762,847		1,821,692
22	純資金流出額		1,219,112		1,251,770
23	単体流動性カバレッジ比率		144.6%		145.5%
24	平均値計算用データ数	60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4四半期)

(単位:百万円)

国際様式の 該当番号		2023年3月期	2022年12月期	2022年9月期	2022年6月期	2022年3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	1,762,847	1,821,692	1,976,851	2,119,310	2,044,276
16	純資金流出額	1,218,907	1,258,481	1,353,303	1,429,302	1,351,538
17	連結流動性カバレッジ比率	144.6%	144.7%	146.0%	148.2%	151.2%

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4四半期)

(単位:百万円)

国際様式の 該当番号		2023年3月期	2022年12月期	2022年9月期	2022年6月期	2022年3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	1,762,847	1,821,692	1,976,851	2,119,310	2,044,276
16	純資金流出額	1,219,112	1,251,770	1,333,329	1,409,174	1,330,136
17	単体流動性カバレッジ比率	144.6%	145.5%	148.2%	150.3%	153.6%