

<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(2024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	2,050,256		2,011,958	
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	4,240,401	332,448	4,212,433	330,997
3	うち、安定預金の額	1,313,545	39,406	1,294,543	38,836
4	うち、準安定預金の額	2,926,855	293,042	2,917,889	292,160
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,208,277	1,245,823	2,112,791	1,123,760
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	1,960,640	998,186	1,838,769	849,738
8	うち、負債性有価証券の額	247,636	247,636	274,022	274,022
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		4,457		18,388
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	1,867,825	644,488	1,915,315	687,609
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	521,229	521,229	563,973	563,973
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	1,346,596	123,259	1,351,342	123,636
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	19,643	3,252	15,237	2,305
15	偶発事象に係る資金流出額	45,763	8,202	40,351	7,689
16	資金流出合計額		2,238,672		2,170,749
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	22	-	-	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	407,088	214,891	392,495	208,887
19	その他資金流入額	504,679	471,271	554,663	529,302
20	資金流入合計額	911,790	686,162	947,159	738,190
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		2,050,256		2,011,958
22	純資金流出額		1,552,509		1,432,559
23	連結流動性カバレッジ比率		132.0%		140.4%
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(2024年3月期 第2四半期)

(単位:百万円)

国際様式の 該当番号		2023年9月期	2023年6月期	2023年3月期	2022年12月期	2022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	2,050,256	2,011,958	1,762,847	1,821,692	
16	純資金流出額	1,552,509	1,432,559	1,221,731	1,263,642	
17	連結流動性カバレッジ比率	132.0%	140.4%	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(2024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	2,050,256		2,011,958	
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	4,240,624	332,471	4,212,671	331,020
3	うち、安定預金の額	1,313,545	39,406	1,294,543	38,836
4	うち、準安定預金の額	2,927,078	293,064	2,918,128	292,184
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,209,877	1,247,203	2,113,104	1,123,880
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	1,961,057	998,383	1,838,791	849,567
8	うち、負債性有価証券の額	248,820	248,820	274,312	274,312
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		4,457		18,388
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	1,885,229	651,485	1,932,269	694,447
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	521,303	521,303	564,083	564,083
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	1,363,926	130,182	1,368,186	130,364
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	19,643	3,252	15,237	2,305
15	偶発事象に係る資金流出額	45,763	8,202	40,351	7,689
16	資金流出合計額		2,247,071		2,177,732
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	22	-	-	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	418,255	226,058	404,153	220,545
19	その他資金流入額	504,716	471,308	554,774	529,413
20	資金流入合計額	922,994	697,366	958,927	749,958
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		2,050,256		2,011,958
22	純資金流出額		1,549,705		1,427,773
23	連結流動性カバレッジ比率		132.2%		140.9%
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(2024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	2,050,256		2,011,958	
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	4,240,624	332,471	4,212,671	331,020
3	うち、安定預金の額	1,313,545	39,406	1,294,543	38,836
4	うち、準安定預金の額	2,927,078	293,064	2,918,128	292,184
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,210,039	1,247,365	2,113,269	1,124,045
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	1,961,219	998,545	1,838,956	849,732
8	うち、負債性有価証券の額	248,820	248,820	274,312	274,312
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		4,457		18,388
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	1,885,229	651,485	1,932,269	694,447
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	521,303	521,303	564,083	564,083
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	1,363,926	130,182	1,368,186	130,364
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	19,643	3,252	15,237	2,305
15	偶発事象に係る資金流出額	45,763	8,202	40,351	7,689
16	資金流出合計額		2,247,233		2,177,897
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	22	-	-	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	418,255	226,058	404,153	220,545
19	その他資金流入額	504,716	471,308	554,774	529,413
20	資金流入合計額	922,994	697,366	958,927	749,958
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		2,050,256		2,011,958
22	純資金流出額		1,549,867		1,427,938
23	単体流動性カバレッジ比率		132.2%		140.8%
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(2024年3月期 第2四半期)

(単位:百万円)

国際様式の 該当番号		2023年9月期	2023年6月期	2023年3月期	2022年12月期	2022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	2,050,256	2,011,958	1,762,847	1,821,692	1,976,851
16	純資金流出額	1,549,705	1,427,773	1,218,907	1,258,481	1,353,303
17	連結流動性カバレッジ比率	132.2%	140.9%	144.6%	144.7%	146.0%

単体流動性カバレッジ比率に関する定量的事項(2024年3月期 第2四半期)

(単位:百万円)

国際様式の 該当番号		2023年9月期	2023年6月期	2023年3月期	2022年12月期	2022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	2,050,256	2,011,958	1,762,847	1,821,692	1,976,851
16	純資金流出額	1,549,867	1,427,938	1,219,112	1,251,770	1,333,329
17	単体流動性カバレッジ比率	132.2%	140.8%	144.6%	145.5%	148.2%