

<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3四半期)

(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	2,198,654		2,050,256	
<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	4,233,781	331,829	4,240,401	332,448
3	うち、安定預金の額	1,312,678	39,380	1,313,545	39,406
4	うち、準安定預金の額	2,921,103	292,449	2,926,855	293,042
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,406,143	1,448,901	2,208,277	1,245,823
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	2,138,073	1,180,831	1,960,640	998,186
8	うち、負債性有価証券の額	268,070	268,070	247,636	247,636
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		7,971		4,457
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	1,937,337	701,856	1,867,825	644,488
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	577,690	577,690	521,229	521,229
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	1,359,647	124,166	1,346,596	123,259
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	5,627	2,058	19,643	3,252
15	偶発事象に係る資金流出額	47,186	8,653	45,763	8,202
16	資金流出合計額		2,501,271		2,238,672
<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	1,622	-	22	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	403,210	215,886	407,088	214,891
19	その他資金流入額	606,831	536,664	504,679	471,271
20	資金流入合計額	1,011,664	752,551	911,790	686,162
<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		2,198,654		2,050,256
22	純資金流出額		1,748,720		1,552,509
23	連結流動性カバレッジ比率		125.7%		132.0%
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>

(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3四半期)

(単位:百万円)

国際様式の 該当番号		2023年12月期	2023年9月期	2023年6月期	2023年3月期	2022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	2,198,654	2,050,256	2,011,958	1,762,847	1,821,692
16	純資金流出額	1,748,720	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	125.7%	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3四半期)

(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	2,198,654		2,050,256	
<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	4,233,927	331,844	4,240,624	332,471
3	うち、安定預金の額	1,312,678	39,380	1,313,545	39,406
4	うち、準安定預金の額	2,921,248	292,463	2,927,078	293,064
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,412,820	1,452,716	2,209,877	1,247,203
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	2,144,265	1,184,162	1,961,057	998,383
8	うち、負債性有価証券の額	268,554	268,554	248,820	248,820
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		7,971		4,457
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	1,953,836	708,485	1,885,229	651,485
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	577,740	577,740	521,303	521,303
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	1,376,096	130,745	1,363,926	130,182
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	5,627	2,058	19,643	3,252
15	偶発事象に係る資金流出額	47,186	8,653	45,763	8,202
16	資金流出合計額		2,511,729		2,247,071
<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	1,622	-	22	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	415,222	227,899	418,255	226,058
19	その他資金流入額	606,831	536,664	504,716	471,308
20	資金流入合計額	1,023,676	764,563	922,994	697,366
<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		2,198,654		2,050,256
22	純資金流出額		1,747,166		1,549,705
23	連結流動性カバレッジ比率		125.8%		132.2%
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>

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3四半期)

(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	2,198,654		2,050,256	
<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	4,233,927	331,844	4,240,624	332,471
3	うち、安定預金の額	1,312,678	39,380	1,313,545	39,406
4	うち、準安定預金の額	2,921,248	292,463	2,927,078	293,064
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,413,018	1,452,915	2,210,039	1,247,365
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	2,144,464	1,184,361	1,961,219	998,545
8	うち、負債性有価証券の額	268,554	268,554	248,820	248,820
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		7,971		4,457
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	1,953,836	708,485	1,885,229	651,485
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	577,740	577,740	521,303	521,303
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	1,376,096	130,745	1,363,926	130,182
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	5,627	2,058	19,643	3,252
15	偶発事象に係る資金流出額	47,186	8,653	45,763	8,202
16	資金流出合計額		2,511,928		2,247,233
<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	1,622	-	22	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	415,222	227,899	418,255	226,058
19	その他資金流入額	606,831	536,664	504,716	471,308
20	資金流入合計額	1,023,676	764,563	922,994	697,366
<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		2,198,654		2,050,256
22	純資金流出額		1,747,364		1,549,867
23	単体流動性カバレッジ比率		125.8%		132.2%
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(2024年3月期 第3四半期)

(単位:百万円)

国際様式の 該当番号		2023年12月期	2023年9月期	2023年6月期	2023年3月期	2022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	2,198,654	2,050,256	2,011,958	1,762,847	1,821,692
16	純資金流出額	1,747,166	1,549,705	1,427,773	1,218,907	1,258,481
17	連結流動性カバレッジ比率	125.8%	132.2%	140.9%	144.6%	144.7%

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3四半期)

(単位:百万円)

国際様式の 該当番号		2023年12月期	2023年9月期	2023年6月期	2023年3月期	2022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	2,198,654	2,050,256	2,011,958	1,762,847	1,821,692
16	純資金流出額	1,747,364	1,549,867	1,427,938	1,219,112	1,251,770
17	単体流動性カバレッジ比率	125.8%	132.2%	140.8%	144.6%	145.5%