

単体流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項(2024年3月期 第2四半期)

(単位:百万円、%、件)

| 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 | 4,627,285 | | 4,583,778 | |
| 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 | 11,485,945 | 911,589 | 11,362,027 | 903,916 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 3,385,791 | 101,573 | 3,318,369 | 99,551 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 8,100,153 | 810,015 | 8,043,657 | 804,365 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 4,574,572 | 2,332,324 | 4,403,425 | 2,171,116 |
| 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 | 4,410,124 | 2,167,876 | 4,302,828 | 2,070,519 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 164,447 | 164,447 | 100,597 | 100,597 |
| 9 | 有担保資金調達等に係る資金流出額 | | 2,911 | | 6,253 |
| 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 | 1,859,751 | 337,819 | 1,865,914 | 343,617 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 208,523 | 208,523 | 215,159 | 215,159 |
| 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 | 1,651,227 | 129,295 | 1,650,754 | 128,457 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 38,817 | 34,187 | 42,025 | 33,488 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 1,659,330 | 71,433 | 1,681,764 | 74,113 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 3,690,265 | | 3,532,506 |
| 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 | 745,978 | 509,501 | 748,478 | 535,301 |
| 19 | その他資金流入額 | 345,921 | 317,402 | 391,462 | 363,474 |
| 20 | 資金流入合計額 | 1,091,900 | 826,904 | 1,139,940 | 898,775 |
| 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 | | 4,627,285 | | 4,583,778 |
| 22 | 純資金流出額 | | 2,863,361 | | 2,633,731 |
| 23 | 単体流動性カバレッジ比率 | | 161.6 | | 174.0 |
| 24 | 平均値計算用データ数 | | 62 | | 62 |