

## 〈流動性カバレッジ比率に関する開示事項〉(2022年9月期 決算)

### 1. 連結流動性カバレッジ比率

(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	1,127,291		1,216,081	
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	3,084,234	229,156	3,036,278	226,844
3	うち、安定預金の額	1,139,961	34,202	1,104,970	33,152
4	うち、準安定預金の額	1,944,272	194,938	1,931,307	193,669
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,532,608	830,760	1,658,799	925,086
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	1,532,608	830,760	1,658,393	924,681
8	うち、負債性有価証券の額	-	-	405	405
9	有担保資金調達等に係る資金流出額				
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	92,377	80,743	68,313	55,494
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	78,829	78,829	53,562	53,562
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	13,547	1,913	14,751	1,932
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	95,827	84,689	135,166	112,058
15	偶発事象に係る資金流出額	553,512	16,391	558,816	16,553
16	資金流出合計額	1,271,392		1,358,262	
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	129,516	129,516	105,836	105,836
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	723,490	665,311	782,876	713,360
19	その他資金流入額	129,517	122,057	140,056	125,961
20	資金流入合計額	982,524	916,885	1,028,769	945,158
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	1,127,291		1,216,081	
22	純資金流出額	399,323		439,811	
23	連結流動性カバレッジ比率	282.2		276.5	
24	平均値計算用データ数	62		61	

上記は、平成27年金融庁告示第7号の別紙様式第2号に基づく開示事項です。

## 2. 単体流動性カバレッジ比率

(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	1,127,291		1,216,081	
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	3,084,234	229,156	3,036,278	226,844
3	うち、安定預金の額	1,139,961	34,202	1,104,970	33,152
4	うち、準安定預金の額	1,944,272	194,938	1,931,307	193,669
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,530,341	828,493	1,661,082	927,369
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	1,530,341	828,493	1,660,676	926,963
8	うち、負債性有価証券の額	-	-	405	405
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		29,650		22,223
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	92,377	80,743	68,313	55,494
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	78,829	78,829	53,562	53,562
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	13,547	1,913	14,751	1,932
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	94,724	83,586	134,077	110,969
15	偶発事象に係る資金流出額	539,133	15,960	544,436	16,122
16	資金流出合計額		1,267,591		1,359,024
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	129,516	129,516	105,836	105,836
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	731,706	674,895	788,981	720,728
19	その他資金流入額	129,526	122,066	140,065	125,970
20	資金流入合計額	990,749	926,478	1,034,882	952,535
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		1,127,291		1,216,081
22	純資金流出額		390,032		435,908
23	単体流動性カバレッジ比率		289.0		278.9
24	平均値計算用データ数	62		61	

上記は、平成27年金融庁告示第7号の別紙様式第1号に基づく開示事項です。