

## 〔経営の健全性の状況のうち、流動性に係る健全性を判断するための基準に係る事項<定量的開示事項>〕

### (流動性カバレッジ比率に関する定量的事項【連結】)

(単位：百万円)

項目		2023年3月期 第2四半期		2023年3月期 第1四半期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,976,851		2,119,310	
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	4,188,163	328,728	4,152,509	326,772
3	うち、安定預金の額	1,292,599	38,777	1,270,005	38,100
4	うち、準安定預金の額	2,895,105	289,950	2,882,033	288,672
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,990,760	1,055,777	2,086,356	1,137,924
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	1,741,905	806,921	1,812,527	864,095
8	うち、負債性有価証券の額	248,855	248,855	273,828	273,828
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		2,040		—
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	1,742,215	523,768	1,819,525	583,307
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	396,651	396,651	454,812	454,812
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	1,345,563	127,117	1,364,713	128,495
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	4,947	3,274	15,736	8,062
15	偶発事象に係る資金流出額	37,579	8,060	37,148	8,211
16	資金流出合計額		1,921,650		2,064,279
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	356,308	200,287	325,230	175,264
19	その他資金流入額	408,580	368,059	491,168	459,712
20	資金流入合計額	764,888	568,346	816,399	634,977
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		1,976,851		2,119,310
22	純資金流出額		1,353,303		1,429,302
23	連結流動性カバレッジ比率		146.0%		148.2%
24	平均値計算用データ数	62件		61件	

(流動性カバレッジ比率に関する定量的事項【単体】)

(単位：百万円)

項目		2023年3月期 第2四半期		2023年3月期 第1四半期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,976,851		2,119,310	
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	4,188,163	328,728	4,152,509	326,772
3	うち、安定預金の額	1,292,599	38,777	1,270,005	38,100
4	うち、準安定預金の額	2,895,105	289,950	2,882,033	288,672
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,981,572	1,046,589	2,077,168	1,128,736
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	1,731,217	796,234	1,802,257	853,825
8	うち、負債性有価証券の額	250,355	250,355	274,910	274,910
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		2,040		—
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	1,742,215	523,768	1,819,525	583,307
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	396,651	396,651	454,812	454,812
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	1,345,563	127,117	1,364,713	128,495
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	4,947	3,274	15,736	8,062
15	偶発事象に係る資金流出額	37,579	8,060	37,148	8,211
16	資金流出合計額		1,912,462		2,055,091
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	367,091	211,071	336,167	186,202
19	その他資金流入額	408,583	368,061	491,171	459,715
20	資金流入合計額	775,675	579,133	827,339	645,917
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		1,976,851		2,119,310
22	純資金流出額		1,333,329		1,409,174
23	単体流動性カバレッジ比率		148.2%		150.3%
24	平均値計算用データ数	62件		61件	

(安定調達比率に関する定量的開示事項【連結】)

(単位：百万円)

項番		2023年3月期 第2四半期					2023年3月期 第1四半期				
		算入率考慮前金額				算入率考慮後金額	算入率考慮前金額				算入率考慮後金額
		満期なし	6月未満	6月以上1年未満	1年以上		満期なし	6月未満	6月以上1年未満	1年以上	
利用可能安定調達額 (1)											
1	資本の額	687,012	—	—	—	687,012	691,878	—	—	—	691,878
2	うち、普通株式等Tier1資本、その他Tier1資本及びTier2資本（基準日から1年を経過する前に弁済期が到来するものを除く。）に係る基礎項目の額	687,012	—	—	—	687,012	691,878	—	—	—	691,878
3	うち、上記に含まれない資本調達手段及び資本の額	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	個人及び中小企業等からの資金調達	4,168,143	—	—	—	3,815,203	4,197,305	—	—	—	3,842,653
5	うち、安定預金等の額	1,277,491	—	—	—	1,213,616	1,301,572	—	—	—	1,236,493
6	うち、準安定預金等の額	2,890,652	—	—	—	2,601,587	2,895,732	—	—	—	2,606,159
7	ホールセール資金調達	1,410,957	936,985	487,037	261,251	1,462,002	1,390,520	1,671,740	305,520	260,220	1,387,581
8	うち、適格オペレーショナル預金の額	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	うち、その他のホールセール資金調達の額	1,410,957	936,985	487,037	261,251	1,462,002	1,390,520	1,671,740	305,520	260,220	1,387,581
10	相互に関係する資産がある負債	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	その他の負債	—	210,770	—	90,194	—	—	211,403	—	71,068	—
12	うち、デリバティブ負債の額	—	—	—	78,817	—	—	—	—	61,948	—
13	うち、上記に含まれない負債の額	—	210,770	—	11,377	—	—	211,403	—	9,120	—
14	利用可能安定調達額合計	—	—	—	—	5,964,218	—	—	—	—	5,922,113
所要安定調達額 (2)											
15	流動資産の額	—	—	—	—	324,484	—	—	—	—	313,384
16	金融機関等に預け入れているオペレーショナル預金に相当するものの額	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
17	貸出金又はレポ形式の取引による資産及び有価証券その他これに類するものの額	184,302	868,161	349,136	3,988,235	4,101,684	197,862	858,941	309,471	3,935,693	4,044,491
18	うち、レベル1資産を担保とする金融機関等への貸出金及びレポ形式の取引による額	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
19	うち、項番18に含まれない金融機関等への貸出金及びレポ形式の取引による額	4,314	38,419	20,195	137,544	154,052	3,032	37,823	13,291	139,124	151,899
20	うち、貸出金又はレポ形式の取引による資産の額（項番18、19及び22に該当する額を除く。）	27,014	790,202	305,215	2,934,913	3,003,865	26,296	790,537	274,279	2,855,074	2,918,992
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	—	42,009	24,663	307,412	233,154	—	50,283	30,124	312,912	243,597
22	うち、住宅ローン債権	—	19,344	19,405	843,063	735,979	—	19,358	19,382	843,931	736,712
23	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
24	うち、流動資産に該当しない有価証券その他これに類するもの	152,974	20,194	4,318	72,713	207,786	168,533	11,221	2,516	97,562	236,887
25	相互に関係する負債がある資産	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
26	その他の資産等	338,273	39,496	17,679	151,584	473,280	362,201	43,937	13,123	126,949	481,217
27	うち、現物決済されるコモディティ（金を含む。）	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
28	うち、デリバティブ取引等又は中央清算機関との取引に関連して預託した当初証拠金又は清算基金（連結貸借対照表に計上されないものを含む。）	—	—	—	5,414	4,602	—	—	—	6,287	5,344
29	うち、デリバティブ資産の額	—	—	—	36,100	—	—	—	—	28,658	—
30	うち、デリバティブ負債（変動証拠金の対価の額を減ずる前）の額	—	—	—	3,940	3,940	—	—	—	3,097	3,097
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	338,273	39,496	17,679	106,127	464,737	362,201	43,937	13,123	88,906	472,775
32	オフ・バランス取引	—	—	—	1,380,850	68,129	—	—	—	1,404,206	69,265
33	所要安定調達額合計	—	—	—	—	4,967,579	—	—	—	—	4,908,359
34	連結安定調達比率	—	—	—	—	120.0%	—	—	—	—	120.6%

(安定調達比率に関する定量的開示事項【単体】)

(単位：百万円)

項番		2023年3月期 第2四半期					2023年3月期 第1四半期				
		算入率考慮前金額				算入率考慮後金額	算入率考慮前金額				算入率考慮後金額
		満期なし	6月末満	6月以上1年末満	1年以上		満期なし	6月末満	6月以上1年末満	1年以上	
利用可能安定調達額 (1)											
1	資本の額	687,012	—	—	—	687,012	691,878	—	—	—	691,878
2	うち、普通株式等Tier1資本、その他Tier1資本及びTier2資本（基準日から1年を経過する前に弁済期が到来するものを除く。）に係る基礎項目の額	687,012	—	—	—	687,012	691,878	—	—	—	691,878
3	うち、上記に含まれない資本調達手段及び資本の額	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4	個人及び中小企業等からの資金調達	4,168,288	—	—	—	3,815,334	4,197,444	—	—	—	3,842,779
5	うち、安定預金等の額	1,277,491	—	—	—	1,213,616	1,301,572	—	—	—	1,236,493
6	うち、準安定預金等の額	2,890,797	—	—	—	2,601,717	2,895,872	—	—	—	2,606,285
7	ホールセール資金調達	1,423,304	951,386	488,037	261,251	1,464,439	1,401,727	1,686,892	305,770	260,220	1,390,103
8	うち、適格オペレーショナル預金の額	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
9	うち、その他のホールセール資金調達の額	1,423,304	951,386	488,037	261,251	1,464,439	1,401,727	1,686,892	305,770	260,220	1,390,103
10	相互に関係する資産がある負債	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	その他の負債	—	152,802	—	90,194	—	—	154,256	—	71,068	—
12	うち、デリバティブ負債の額	—	—	—	78,817	—	—	—	—	61,948	—
13	うち、上記に含まれない負債の額	—	152,802	—	11,377	—	—	154,256	—	9,120	—
14	利用可能安定調達額合計	—	—	—	—	5,966,786	—	—	—	—	5,924,761
所要安定調達額 (2)											
15	流動資産の額	—	—	—	—	324,484	—	—	—	—	313,384
16	金融機関等に預け入れているオペレーショナル預金に相当するものの額	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
17	貸出金又はレポ形式の取引による資産及び有価証券その他これに類するものの額	202,361	881,194	351,193	3,995,903	4,130,394	215,921	872,073	311,453	3,943,528	4,073,345
18	うち、レベル1資産を担保とする金融機関等への貸出金及びレポ形式の取引による額	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
19	うち、項番18に含まれない金融機関等への貸出金及びレポ形式の取引による額	4,314	51,452	22,252	145,212	164,704	3,032	50,955	15,273	146,959	162,694
20	うち、貸出金又はレポ形式の取引による資産の額（項番18、19及び22に該当する額を除く。）	27,014	790,202	305,215	2,934,913	3,003,865	26,296	790,537	274,279	2,855,074	2,918,992
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	—	42,009	24,663	307,412	233,154	—	50,283	30,124	312,912	243,597
22	うち、住宅ローン債権	—	19,344	19,405	843,063	735,979	—	19,358	19,382	843,931	736,712
23	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
24	うち、流動資産に該当しない有価証券その他これに類するもの	171,033	20,194	4,318	72,713	225,845	186,592	11,221	2,516	97,562	254,946
25	相互に関係する負債がある資産	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
26	その他の資産等	265,329	39,496	17,679	153,636	402,389	288,769	43,937	13,123	128,975	409,811
27	うち、現物決済されるコモディティ（金を含む。）	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
28	うち、デリバティブ取引等又は中央清算機関との取引に関連して預託した当初証拠金又は清算基金（連結貸借対照表に計上されないものを含む。）	—	—	—	5,414	4,602	—	—	—	6,287	5,344
29	うち、デリバティブ資産の額	—	—	—	36,100	—	—	—	—	28,658	—
30	うち、デリバティブ負債（変動証拠金の対価の額を減ずる前）の額	—	—	—	3,940	3,940	—	—	—	3,097	3,097
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	265,329	39,496	17,679	108,179	393,846	288,769	43,937	13,123	90,932	401,369
32	オフ・バランス取引	—	—	—	1,380,850	68,129	—	—	—	1,404,206	69,265
33	所要安定調達額合計	—	—	—	—	4,925,398	—	—	—	—	4,865,806
34	単体安定調達比率	—	—	—	—	121.1%	—	—	—	—	121.7%