

〔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		2024年3月期 第4四半期		2024年3月期 第3四半期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	2,003,569		2,198,654	
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	4,245,544	331,804	4,233,781	331,829
3	うち、安定預金の額	1,329,427	39,882	1,312,678	39,380
4	うち、準安定預金の額	2,916,117	291,921	2,921,103	292,449
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,404,967	1,428,973	2,406,143	1,448,901
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	2,057,837	1,081,844	2,138,073	1,180,831
8	うち、負債性有価証券の額	347,129	347,129	268,070	268,070
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		2,447		7,971
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	1,990,612	764,903	1,937,337	701,856
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	642,738	642,738	577,690	577,690
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	1,347,874	122,165	1,359,647	124,166
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	20,608	2,200	5,627	2,058
15	偶発事象に係る資金流出額	49,276	9,235	47,186	8,653
16	資金流出合計額		2,539,565		2,501,271
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	—	—	1,622	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	434,519	229,741	403,210	215,886
19	その他資金流入額	625,379	609,164	606,831	536,664
20	資金流入合計額	1,059,899	838,905	1,011,664	752,551
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		2,003,569		2,198,654
22	純資金流出額		1,700,659		1,748,720
23	連結流動性カバレッジ比率		117.8%		125.7%
24	平均値計算用データ数	58件		62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		2024年3月期 第4四半期					2024年3月期 第3四半期				
		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	773,064	—	—	—	773,064	744,507	—	—	—	744,507
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	773,064	—	—	—	773,064	744,507	—	—	—	744,507
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	4,243,271	—	—	—	3,885,169	4,272,405	—	—	—	3,912,699
5	うち、安定預金等の額	1,324,513	—	—	—	1,258,288	1,350,693	—	—	—	1,283,158
6	うち、準安定預金等の額	2,918,757	—	—	—	2,626,881	2,921,712	—	—	—	2,629,540
7	ホールセール資金調達	1,702,997	1,342,316	208,500	601,037	1,762,026	1,493,282	1,422,320	200,068	491,863	1,645,412
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	1,702,997	1,342,316	208,500	601,037	1,762,026	1,493,282	1,422,320	200,068	491,863	1,645,412
10	相互に関係する資産がある負債	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	その他の負債	—	311,066	—	94,055	—	—	382,565	—	88,613	—
12	うち、デリバティブ負債の額				76,131					75,551	
13	うち、上記に含まれない負債の額	—	311,066	—	17,923	—	—	382,565	—	13,061	—
14	利用可能安定調達額合計					6,420,261					6,302,619
所要安定調達額（2）											
15	流動資産の額					398,259					378,323
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	貸出金又はレボ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	188,762	930,519	339,165	4,304,881	4,391,624	165,050	962,626	344,843	4,194,304	4,306,982
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ボ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ボ形式の取引による額	2,811	34,212	11,323	143,908	155,123	2,548	34,989	14,664	154,648	167,611
20	うち、貸出金又はレボ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。）	25,236	856,393	305,348	3,291,048	3,323,671	24,355	884,109	308,202	3,170,729	3,246,326
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	—	31,898	46,708	380,208	286,439	—	50,018	29,052	328,253	252,900
22	うち、住宅ローン債権	—	19,475	19,429	832,805	727,337	—	19,441	19,417	833,402	727,822
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	160,714	20,437	3,064	37,118	185,491	138,146	24,084	2,559	35,523	165,222
25	相互に関係する負債がある資産	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
26	その他の資産等	385,317	47,148	16,665	140,411	511,323	399,911	44,372	19,689	144,727	534,554
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。）				7,634	6,489				9,107	7,741
29	うち、デリバティブ資産の額				45,941	—				46,870	—
30	うち、デリバティブ負債（変動証拠金の対価の額を準ずる前）の額				3,806	3,806				3,777	3,777
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	385,317	47,148	16,665	83,029	501,027	399,911	44,372	19,689	84,972	523,036
32	オフ・バランス取引				1,421,137	69,854				1,405,835	69,067
33	所要安定調達額合計					5,371,061					5,288,927
34	連結安定調達比率					119.5%					119.1%