

[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	4,245,690	331,819	4,233,927	331,844
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	2,916,262	291,936	2,921,248	292,463
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,407,070	1,427,656	2,412,820	1,452,716
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	2,058,763	1,079,349	2,144,265	1,184,162
8	うち、負債性有価証券の額	348,306	348,306	268,554	268,554
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	2,006,762	771,422	1,953,836	708,485
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	642,836	642,836	577,740	577,740
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	1,363,926	128,586	1,376,096	130,745
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	—	2,544,781	—	2,511,729
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	446,802	242,023	415,222	227,899
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	1,072,181	851,188	1,023,676	764,563
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	—	1,693,593	—	1,747,166
23	連結流動性カバレッジ比率	—	118.3%	—	125.8%
24	平均値計算用データ数	58件		62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		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	4,245,690	331,819	4,233,927	331,844
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	2,916,262	291,936	2,921,248	292,463
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,407,253	1,427,839	2,413,018	1,452,915
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	2,058,947	1,079,533	2,144,464	1,184,361
8	うち、負債性有価証券の額	348,306	348,306	268,554	268,554
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	2,006,762	771,422	1,953,836	708,485
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	642,836	642,836	577,740	577,740
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	1,363,926	128,586	1,376,096	130,745
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		2,544,965		2,511,928
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	446,802	242,023	415,222	227,899
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	1,072,181	851,188	1,023,676	764,563
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		2,003,569		2,198,654
22	純資金流出額		1,693,777		1,747,364
23	単体流動性カバレッジ比率		118.2%		125.8%
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	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	4,243,395	—	—	—	3,885,281	4,272,555	—	—	—	3,912,834
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	2,918,881	—	—	—	2,626,993	2,921,862	—	—	—	2,629,675
7	ホールセール資金調達	1,717,380	1,351,546	208,500	601,037	1,765,681	1,505,172	1,430,800	200,818	491,863	1,648,935
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	1,717,380	1,351,546	208,500	601,037	1,765,681	1,505,172	1,430,800	200,818	491,863	1,648,935
10	相互に関係する資産がある負債	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	その他の負債	—	242,964	—	94,055	—	—	206,354	—	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	—	242,964	—	17,923	—	—	206,354	—	13,061	—
14	利用可能安定調達額合計	—	—	—	—	6,424,027	—	—	—	—	6,306,277
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	944,682	341,102	4,312,443	4,402,278	165,050	976,752	346,675	4,200,841	4,316,554
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	48,374	13,260	151,470	165,778	2,548	49,116	16,496	161,185	177,183
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	315,241	47,148	16,665	142,460	443,297	329,374	44,372	19,689	146,861	466,152
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	315,241	47,148	16,665	85,078	433,001	329,374	44,372	19,689	87,106	454,633
32	オフ・バランス取引	—	—	—	1,437,237	70,659	—	—	—	1,421,916	69,871
33	所要安定調達額合計	—	—	—	—	5,314,495	—	—	—	—	5,230,901
34	連結安定調達比率	—	—	—	—	120.8%	—	—	—	—	120.5%

(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		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	4,243,439	—	—	—	3,885,321	4,272,591	—	—	—	3,912,867
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	2,918,926	—	—	—	2,627,033	2,921,898	—	—	—	2,629,708
7	ホールセール資金調達	1,717,602	1,351,546	208,500	601,037	1,765,681	1,505,363	1,430,800	200,818	491,863	1,648,935
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	1,717,602	1,351,546	208,500	601,037	1,765,681	1,505,363	1,430,800	200,818	491,863	1,648,935
10	相互に関係する資産がある負債	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	その他の負債	—	224,066	—	94,055	—	—	196,025	—	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	—	224,066	—	17,923	—	—	196,025	—	13,061	—
14	利用可能安定調達額合計	—	—	—	—	6,424,067	—	—	—	—	6,306,310
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	188,782	944,682	341,102	4,312,443	4,402,298	165,070	976,752	346,675	4,200,841	4,316,574
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	2,811	48,374	13,260	151,470	165,778	2,548	49,116	16,496	161,185	177,183
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。）	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	160,734	20,437	3,064	37,118	185,511	138,166	24,084	2,559	35,523	165,242
25	相互に関係する負債がある資産	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
26	その他の資産等	296,590	47,148	16,665	142,460	424,646	319,252	44,372	19,689	146,861	456,030
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	296,590	47,148	16,665	85,078	414,350	319,252	44,372	19,689	87,106	444,512
32	オフ・バランス取引	—	—	—	1,437,237	70,659	—	—	—	1,421,916	69,871
33	所要安定調達額合計	—	—	—	—	5,295,863	—	—	—	—	5,220,800
34	単体安定調達比率	—	—	—	—	121.3%	—	—	—	—	120.7%