

<流動性比率規制に関する開示>

連結安定調達比率に関する定量的事項(2024年3月期 第3四半期)

(単位:百万円)

| 項番 | | 当四半期 | | | | | 前四半期 | | | | |
|---------------------|--|-----------|-----------|----------|-----------|-----------|-----------|-----------|----------|-----------|-----------|
| | | 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 | 744,507 | - | - | - | 744,507 | 722,509 | - | - | - | 722,509 |
| 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 | 744,507 | - | - | - | 744,507 | 722,509 | - | - | - | 722,509 |
| 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 | 4,272,405 | - | - | - | 3,912,699 | 4,226,676 | - | - | - | 3,869,277 |
| 5 | うち、安定預金等の額 | 1,350,693 | - | - | - | 1,283,158 | 1,305,376 | - | - | - | 1,240,107 |
| 6 | うち、準安定預金等の額 | 2,921,712 | - | - | - | 2,629,540 | 2,921,299 | - | - | - | 2,629,169 |
| 7 | ホールセール資金調達 | 1,493,282 | 1,422,320 | 200,068 | 491,863 | 1,645,412 | 1,509,606 | 1,163,814 | 294,618 | 510,552 | 1,679,110 |
| 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 | 1,493,282 | 1,422,320 | 200,068 | 491,863 | 1,645,412 | 1,509,606 | 1,163,814 | 294,618 | 510,552 | 1,679,110 |
| 10 | 相互に関係する資産がある負債 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 11 | その他の負債 | - | 382,565 | - | 88,613 | - | - | 415,237 | - | 100,295 | - |
| 12 | うち、デリバティブ負債の額 | - | - | - | 75,551 | - | - | - | - | 79,034 | - |
| 13 | うち、上記に含まれない負債の額 | - | 382,565 | - | 13,061 | - | - | 415,237 | - | 21,260 | - |
| 14 | 利用可能安定調達額合計 | - | - | - | - | 6,302,619 | - | - | - | - | 6,270,897 |
| 所要安定調達額(2) | | | | | | | | | | | |
| 15 | 流動資産の額 | - | - | - | - | 378,323 | - | - | - | - | 392,228 |
| 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 | 165,050 | 962,626 | 344,843 | 4,194,304 | 4,306,982 | 182,833 | 948,083 | 317,607 | 4,185,636 | 4,290,304 |
| 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 | 2,548 | 34,989 | 14,664 | 154,648 | 167,611 | 2,968 | 36,460 | 12,354 | 151,293 | 163,385 |
| 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。) | 24,355 | 884,109 | 308,202 | 3,170,729 | 3,246,326 | 25,783 | 879,079 | 279,230 | 3,155,916 | 3,215,263 |
| 21 | うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額 | - | 50,018 | 29,052 | 328,253 | 252,900 | - | 46,274 | 23,736 | 341,683 | 257,099 |
| 22 | うち、住宅ローン債権 | - | 19,441 | 19,417 | 833,402 | 727,822 | - | 19,465 | 19,332 | 834,198 | 728,467 |
| 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 | 138,146 | 24,084 | 2,559 | 35,523 | 165,222 | 154,081 | 13,079 | 6,688 | 44,228 | 183,188 |
| 25 | 相互に関係する負債がある資産 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 26 | その他の資産等 | 399,911 | 44,372 | 19,689 | 144,727 | 534,554 | 373,675 | 44,833 | 19,024 | 157,003 | 510,666 |
| 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。) | - | - | - | 9,107 | 7,741 | - | - | - | 9,445 | 8,028 |
| 29 | うち、デリバティブ資産の額 | - | - | - | 46,870 | - | - | - | - | 50,318 | - |
| 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 | - | - | - | 3,777 | 3,777 | - | - | - | 3,951 | 3,951 |
| 31 | うち、上記に含まれない資産及び資本の額 | 399,911 | 44,372 | 19,689 | 84,972 | 523,036 | 373,675 | 44,833 | 19,024 | 93,287 | 498,685 |
| 32 | オフ・バランス取引 | - | - | - | 1,405,835 | 69,067 | - | - | - | 1,406,355 | 69,153 |
| 33 | 所要安定調達額合計 | - | - | - | - | 5,288,927 | - | - | - | - | 5,262,352 |
| 34 | 連結安定調達比率 | - | - | - | - | 119.1% | - | - | - | - | 119.1% |

<流動性比率規制に関する開示>

(KM1 主要な指標)

連結安定調達比率に関する定量的事項(2024年3月期 第3四半期)

(単位:百万円)

| 国際様式の 該当番号 | | 2023年12月期 | 2023年9月期 | 2023年6月期 | 2023年3月期 | 2022年12月期 |
|---------------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 連結安定調達比率 | | | | | | |
| 18 | 利用可能安定調達額 | 6,302,619 | 6,270,897 | 6,318,379 | 6,127,514 | 5,959,757 |
| 19 | 所要安定調達額 | 5,288,927 | 5,262,352 | 5,191,238 | 5,083,580 | 4,973,331 |
| 20 | 連結安定調達比率 | 119.1% | 119.1% | 121.7% | 120.5% | 119.8% |

<流動性比率規制に関する開示>

連結安定調達比率に関する定量的事項(2024年3月期 第3四半期)

(単位:百万円)

| 項番 | | 当四半期 | | | | | 前四半期 | | | | |
|---------------------|--|-----------|-----------|--------------|-----------|--------------|-----------|-----------|--------------|-----------|--------------|
| | | 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 | 744,507 | - | - | - | 744,507 | 722,509 | - | - | - | 722,509 |
| 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 | 744,507 | - | - | - | 744,507 | 722,509 | - | - | - | 722,509 |
| 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 | 4,272,555 | - | - | - | 3,912,834 | 4,226,821 | - | - | - | 3,869,408 |
| 5 | うち、安定預金等の額 | 1,350,693 | - | - | - | 1,283,158 | 1,305,376 | - | - | - | 1,240,107 |
| 6 | うち、準安定預金等の額 | 2,921,862 | - | - | - | 2,629,675 | 2,921,445 | - | - | - | 2,629,300 |
| 7 | ホールセール資金調達 | 1,505,172 | 1,430,800 | 200,818 | 491,863 | 1,648,935 | 1,525,058 | 1,172,044 | 295,618 | 510,552 | 1,682,694 |
| 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 | 1,505,172 | 1,430,800 | 200,818 | 491,863 | 1,648,935 | 1,525,058 | 1,172,044 | 295,618 | 510,552 | 1,682,694 |
| 10 | 相互に関する資産がある負債 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 11 | その他の負債 | - | 206,354 | - | 88,613 | - | - | 214,655 | - | 100,295 | - |
| 12 | うち、デリバティブ負債の額 | - | - | - | 75,551 | - | - | - | - | 79,034 | - |
| 13 | うち、上記に含まれない負債の額 | - | 206,354 | - | 13,061 | - | - | 214,655 | - | 21,260 | - |
| 14 | 利用可能安定調達額合計 | | | | | 6,306,277 | | | | | 6,274,613 |
| 所要安定調達額(2) | | | | | | | | | | | |
| 15 | 流動資産の額 | | | | | 378,323 | | | | | 392,228 |
| 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 | 165,050 | 976,752 | 346,675 | 4,200,841 | 4,316,554 | 182,833 | 961,940 | 319,339 | 4,191,365 | 4,298,978 |
| 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 | 2,548 | 49,116 | 16,496 | 161,185 | 177,183 | 2,968 | 50,317 | 14,087 | 157,022 | 172,058 |
| 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。) | 24,355 | 884,109 | 308,202 | 3,170,729 | 3,246,326 | 25,783 | 879,079 | 279,230 | 3,155,916 | 3,215,263 |
| 21 | うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額 | - | 50,018 | 29,052 | 328,253 | 252,900 | - | 46,274 | 23,736 | 341,683 | 257,099 |
| 22 | うち、住宅ローン債権 | - | 19,441 | 19,417 | 833,402 | 727,822 | - | 19,465 | 19,332 | 834,198 | 728,467 |
| 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 | 138,146 | 24,084 | 2,559 | 35,523 | 165,222 | 154,081 | 13,079 | 6,688 | 44,228 | 183,188 |
| 25 | 相互に関する負債がある資産 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 26 | その他の資産等 | 329,374 | 44,372 | 19,689 | 146,861 | 466,152 | 307,900 | 44,833 | 19,024 | 158,987 | 446,876 |
| 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。) | | | | 9,107 | 7,741 | | | | 9,445 | 8,028 |
| 29 | うち、デリバティブ資産の額 | | | | 46,870 | - | | | | 50,318 | - |
| 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 | | | | 3,777 | 3,777 | | | | 3,951 | 3,951 |
| 31 | うち、上記に含まれない資産及び資本の額 | 329,374 | 44,372 | 19,689 | 87,106 | 454,633 | 307,900 | 44,833 | 19,024 | 95,272 | 434,896 |
| 32 | オフ・バランス取引 | | | | 1,421,916 | 69,871 | | | | 1,422,655 | 69,968 |
| 33 | 所要安定調達額合計 | | | | | 5,230,901 | | | | | 5,208,051 |
| 34 | 連結安定調達比率 | | | | | 120.5% | | | | | 120.4% |

<流動性比率規制に関する開示>

単体安定調達比率に関する定量的事項(2024年3月期 第3四半期)

(単位:百万円)

| 項番 | | 当四半期 | | | | | 前四半期 | | | | |
|---------------------|--|-----------|-----------|----------|-----------|-----------|-----------|-----------|----------|-----------|-----------|
| | | 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 | 744,507 | - | - | - | 744,507 | 722,509 | - | - | - | 722,509 |
| 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 | 744,507 | - | - | - | 744,507 | 722,509 | - | - | - | 722,509 |
| 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 | 4,272,591 | - | - | - | 3,912,867 | 4,226,858 | - | - | - | 3,869,441 |
| 5 | うち、安定預金等の額 | 1,350,693 | - | - | - | 1,283,158 | 1,305,376 | - | - | - | 1,240,107 |
| 6 | うち、準安定預金等の額 | 2,921,898 | - | - | - | 2,629,708 | 2,921,481 | - | - | - | 2,629,333 |
| 7 | ホールセール資金調達 | 1,505,363 | 1,430,800 | 200,818 | 491,863 | 1,648,935 | 1,525,273 | 1,172,044 | 295,618 | 510,552 | 1,682,694 |
| 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 | 1,505,363 | 1,430,800 | 200,818 | 491,863 | 1,648,935 | 1,525,273 | 1,172,044 | 295,618 | 510,552 | 1,682,694 |
| 10 | 相互に関する資産がある負債 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 11 | その他の負債 | - | 196,025 | - | 88,613 | - | - | 203,766 | - | 100,295 | - |
| 12 | うち、デリバティブ負債の額 | - | - | - | 75,551 | - | - | - | - | 79,034 | - |
| 13 | うち、上記に含まれない負債の額 | - | 196,025 | - | 13,061 | - | - | 203,766 | - | 21,260 | - |
| 14 | 利用可能安定調達額合計 | - | - | - | - | 6,306,310 | - | - | - | - | 6,274,645 |
| 所要安定調達額(2) | | | | | | | | | | | |
| 15 | 流動資産の額 | - | - | - | - | 378,323 | - | - | - | - | 392,228 |
| 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 | 165,070 | 976,752 | 346,675 | 4,200,841 | 4,316,574 | 182,853 | 961,940 | 319,339 | 4,191,365 | 4,298,998 |
| 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 | 2,548 | 49,116 | 16,496 | 161,185 | 177,183 | 2,968 | 50,317 | 14,087 | 157,022 | 172,058 |
| 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。) | 24,355 | 884,109 | 308,202 | 3,170,729 | 3,246,326 | 25,783 | 879,079 | 279,230 | 3,155,916 | 3,215,263 |
| 21 | うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額 | - | 50,018 | 29,052 | 328,253 | 252,900 | - | 46,274 | 23,736 | 341,683 | 257,099 |
| 22 | うち、住宅ローン債権 | - | 19,441 | 19,417 | 833,402 | 727,822 | - | 19,465 | 19,332 | 834,198 | 728,467 |
| 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 | 138,166 | 24,084 | 2,559 | 35,523 | 165,242 | 154,101 | 13,079 | 6,688 | 44,228 | 183,208 |
| 25 | 相互に関する負債がある資産 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 26 | その他の資産等 | 319,252 | 44,372 | 19,689 | 146,861 | 456,030 | 297,242 | 44,833 | 19,024 | 158,987 | 436,218 |
| 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。) | - | - | - | 9,107 | 7,741 | - | - | - | 9,445 | 8,028 |
| 29 | うち、デリバティブ資産の額 | - | - | - | 46,870 | - | - | - | - | 50,318 | - |
| 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 | - | - | - | 3,777 | 3,777 | - | - | - | 3,951 | 3,951 |
| 31 | うち、上記に含まれない資産及び資本の額 | 319,252 | 44,372 | 19,689 | 87,106 | 444,512 | 297,242 | 44,833 | 19,024 | 95,272 | 424,237 |
| 32 | オフ・バランス取引 | - | - | - | 1,421,916 | 69,871 | - | - | - | 1,422,655 | 69,968 |
| 33 | 所要安定調達額合計 | - | - | - | - | 5,220,800 | - | - | - | - | 5,197,413 |
| 34 | 単体安定調達比率 | - | - | - | - | 120.7% | - | - | - | - | 120.7% |

<流動性比率規制に関する開示>

(KM1 主要な指標)

連結安定調達比率に関する定量的事項(2024年3月期 第3四半期)

(単位:百万円)

| 国際様式の 該当番号 | | 2023年12月期 | 2023年9月期 | 2023年6月期 | 2023年3月期 | 2022年12月期 |
|---------------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 連結安定調達比率 | | | | | | |
| 18 | 利用可能安定調達額 | 6,306,277 | 6,274,613 | 6,321,063 | 6,131,859 | 5,963,357 |
| 19 | 所要安定調達額 | 5,230,901 | 5,208,051 | 5,132,456 | 5,025,758 | 4,921,307 |
| 20 | 連結安定調達比率 | 120.5% | 120.4% | 123.1% | 122.0% | 121.1% |

単体安定調達比率に関する定量的事項(2024年3月期 第3四半期)

(単位:百万円)

| 国際様式の 該当番号 | | 2023年12月期 | 2023年9月期 | 2023年6月期 | 2023年3月期 | 2022年12月期 |
|---------------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 単体安定調達比率 | | | | | | |
| 18 | 利用可能安定調達額 | 6,306,310 | 6,274,645 | 6,321,094 | 6,131,893 | 5,963,388 |
| 19 | 所要安定調達額 | 5,220,800 | 5,197,413 | 5,121,269 | 5,014,026 | 4,912,109 |
| 20 | 単体安定調達比率 | 120.7% | 120.7% | 123.4% | 122.2% | 121.4% |