

# [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		2022年3月期 第2四半期		2022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	2,108,740		2,197,946	
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	4,088,920	322,181	4,048,812	319,801
3	うち、安定預金の額	1,246,234	37,387	1,223,450	36,703
4	うち、準安定預金の額	2,842,472	284,794	2,825,207	283,098
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,955,042	1,068,425	2,141,320	1,246,374
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	1,695,441	808,824	1,881,255	986,309
8	うち、負債性有価証券の額	259,601	259,601	260,064	260,064
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		13,573		13,859
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	1,589,186	374,154	1,579,794	364,428
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	247,935	247,935	238,118	238,118
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	1,341,250	126,218	1,341,675	126,310
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	7,622	5,495	4,071	1,867
15	偶発事象に係る資金流出額	35,747	6,991	35,230	6,537
16	資金流出合計額		1,790,821		1,952,869
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	337,558	181,800	322,632	174,208
19	その他資金流入額	298,544	268,285	323,221	270,864
20	資金流入合計額	636,103	450,085	645,853	445,073
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		2,108,740		2,197,946
22	純資金流出額		1,340,735		1,507,795
23	連結流動性カバレッジ比率		157.2%		145.7%
24	平均値計算用データ数	61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		2022年3月期 第2四半期		2022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	2,108,740		2,197,946	
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	4,088,920	322,181	4,048,812	319,801
3	うち、安定預金の額	1,246,234	37,387	1,223,450	36,703
4	うち、準安定預金の額	2,842,472	284,794	2,825,207	283,098
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,943,310	1,056,693	2,127,209	1,232,263
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	1,682,233	795,616	1,866,158	971,212
8	うち、負債性有価証券の額	261,076	261,076	261,051	261,051
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		13,573		13,859
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	1,589,186	374,154	1,579,794	364,428
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	247,935	247,935	238,118	238,118
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	1,341,250	126,218	1,341,675	126,310
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	7,622	5,495	4,071	1,867
15	偶発事象に係る資金流出額	35,747	6,991	35,230	6,537
16	資金流出合計額		1,779,089		1,938,758
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	348,516	192,758	333,537	185,114
19	その他資金流入額	298,547	268,288	323,224	270,868
20	資金流入合計額	647,064	461,046	656,762	455,982
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		2,108,740		2,197,946
22	純資金流出額		1,318,042		1,482,776
23	単体流動性カバレッジ比率		159.9%		148.2%
24	平均値計算用データ数	61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		2022年3月期 第2四半期					2022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	711,796	—	—	—	711,796					
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	711,796	—	—	—	711,796					
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	4,075,344	—	—	—	3,729,556					
5	うち、安定預金等の額	1,234,919	—	—	—	1,173,173					
6	うち、準安定預金等の額	2,840,425	—	—	—	2,556,383					
7	ホールセール資金調達	1,281,808	1,670,385	332,445	234,234	1,352,009					
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	1,281,808	1,670,385	332,445	234,234	1,352,009					
10	相互に関係する資産がある負債	—	—	—	—	—					
11	その他の負債	—	223,469	—	21,533	—					
12	うち、デリバティブ負債の額				17,376						
13	うち、上記に含まれない負債の額	—	223,469	—	4,157	—					
14	利用可能安定調達額合計					5,793,361					
所要安定調達額（2）											
15	流動資産の額					371,768					
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	259,933	834,261	322,866	3,714,511	3,899,229					
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	1,865	36,128	14,743	106,589	119,659					
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。）	29,090	767,709	277,501	2,735,090	2,805,984					
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	—	44,656	24,543	330,880	249,672					
22	うち、住宅ローン債権	—	19,273	19,304	836,316	730,158					
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	228,978	11,151	11,318	36,516	243,428					
25	相互に関係する負債がある資産	—	—	—	—	—					
26	その他の資産等	372,076	37,485	16,783	121,698	529,230					
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。）				3,735	3,174					
29	うち、デリバティブ資産の額				12,313	—					
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				868	868					
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	372,076	37,485	16,783	104,782	525,188					
32	オフ・バランス取引				1,376,980	67,959					
33	所要安定調達額合計					4,868,186					
34	連結安定調達比率					119.0%					

## (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		2022年3月期 第2四半期					2022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	711,796	—	—	—	711,796					
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	711,796	—	—	—	711,796					
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	4,075,588	—	—	—	3,729,775					
5	うち、安定預金等の額	1,234,919	—	—	—	1,173,173					
6	うち、準安定預金等の額	2,840,669	—	—	—	2,556,602					
7	ホールセール資金調達	1,292,061	1,683,887	333,445	234,234	1,354,329					
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	1,292,061	1,683,887	333,445	234,234	1,354,329					
10	相互に関係する資産がある負債	—	—	—	—	—					
11	その他の負債	—	160,431	—	21,533	—					
12	うち、デリバティブ負債の額				17,376						
13	うち、上記に含まれない負債の額	—	160,431	—	4,157	—					
14	利用可能安定調達額合計					5,795,900					
所要安定調達額（2）											
15	流動資産の額					371,768					
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	277,992	847,793	324,948	3,722,318	3,925,458					
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	1,865	49,660	16,825	114,396	130,538					
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。）	29,090	767,709	277,501	2,735,090	2,805,984					
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	—	44,656	24,543	330,880	249,672					
22	うち、住宅ローン債権	—	19,273	19,304	836,316	730,158					
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	247,037	11,151	11,318	36,516	258,778					
25	相互に関係する負債がある資産	—	—	—	—	—					
26	その他の資産等	290,298	37,485	16,783	123,954	449,709					
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。）				3,735	3,174					
29	うち、デリバティブ資産の額				12,313	—					
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				868	868					
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	290,298	37,485	16,783	107,038	445,667					
32	オフ・バランス取引				1,376,980	67,959					
33	所要安定調達額合計					4,814,894					
34	単体安定調達比率					120.3%					