

[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、%、件)

項目		2022年3月期 第4四半期		2022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	2,044,276		2,047,975	
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	4,129,669	324,603	4,099,242	323,016
3	うち、安定預金の額	1,269,432	38,082	1,248,798	37,463
4	うち、準安定預金の額	2,859,881	286,520	2,850,214	285,552
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,971,226	1,061,036	1,831,586	947,629
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	1,700,271	790,082	1,566,977	683,019
8	うち、負債性有価証券の額	270,954	270,954	264,609	264,609
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	—	—	—	11,387
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	1,709,070	479,537	1,667,826	439,911
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	351,681	351,681	312,528	312,528
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	1,357,388	127,855	1,355,298	127,383
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	19,647	15,739	2,878	1,349
15	偶発事象に係る資金流出額	37,708	8,721	36,606	7,467
16	資金流出合計額	—	1,889,639	—	1,730,763
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	349,117	187,319	312,901	169,837
19	その他資金流入額	405,116	350,781	346,169	325,915
20	資金流入合計額	754,234	538,100	659,070	495,752
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	—	2,044,276	—	2,047,975
22	純資金流出額	—	1,351,538	—	1,235,010
23	連結流動性カバレッジ比率	—	151.2%	—	165.8%
24	平均値計算用データ数	59件		63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、%、件)

項目		2022年3月期 第4四半期		2022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	2,044,276		2,047,975	
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	4,129,669	324,603	4,099,242	323,016
3	うち、安定預金の額	1,269,432	38,082	1,248,798	37,463
4	うち、準安定預金の額	2,859,881	286,520	2,850,214	285,552
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,960,661	1,050,471	1,820,804	936,846
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	1,688,232	778,043	1,555,237	671,280
8	うち、負債性有価証券の額	272,428	272,428	265,566	265,566
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	—	—	—	11,387
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	1,709,070	479,537	1,667,826	439,911
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	351,681	351,681	312,528	312,528
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	1,357,388	127,855	1,355,298	127,383
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	19,647	15,739	2,878	1,349
15	偶発事象に係る資金流出額	37,708	8,721	36,606	7,467
16	資金流出合計額	—	1,879,074	—	1,719,980
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	359,951	198,153	323,747	180,684
19	その他資金流入額	405,119	350,784	346,172	325,918
20	資金流入合計額	765,071	548,937	669,920	506,602
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	—	2,044,276	—	2,047,975
22	純資金流出額	—	1,330,136	—	1,213,378
23	単体流動性カバレッジ比率	—	153.6%	—	168.7%
24	平均値計算用データ数	59件		63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4四半期					2022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	691,348	—	—	—	691,348	718,247	—	—	—	718,247
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	691,348	—	—	—	691,348	718,247	—	—	—	718,247
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	4,128,963	—	—	—	3,779,273	4,150,914	—	—	—	3,800,279
5	うち、安定預金等の額	1,264,125	—	—	—	1,200,919	1,289,132	—	—	—	1,224,676
6	うち、準安定預金等の額	2,864,837	—	—	—	2,578,353	2,861,781	—	—	—	2,575,603
7	ホールセール資金調達	1,423,345	1,606,965	173,671	260,894	1,320,955	1,310,065	1,822,921	182,978	232,310	1,300,846
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	1,423,345	1,606,965	173,671	260,894	1,320,955	1,310,065	1,822,921	182,978	232,310	1,300,846
10	相互に関係する資産がある負債	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	その他の負債	—	214,935	—	51,091	—	—	215,311	—	27,835	—
12	うち、デリバティブ負債の額	—	—	—	44,587	—	—	—	—	25,804	—
13	うち、上記に含まれない負債の額	—	214,935	—	6,503	—	—	215,311	—	2,030	—
14	利用可能安定調達額合計	—	—	—	—	5,791,576	—	—	—	—	5,819,372
所要安定調達額 (2)											
15	流動資産の額	—	—	—	—	319,101	—	—	—	—	355,579
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	199,759	849,524	320,880	3,868,230	3,987,284	199,990	887,361	318,339	3,776,201	3,924,265
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	3,557	39,531	19,255	136,641	152,732	4,415	36,582	17,952	107,434	122,560
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。）	27,820	772,247	279,228	2,793,008	2,859,728	27,093	812,774	277,133	2,718,699	2,816,478
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	—	28,533	38,956	318,572	240,817	—	47,781	35,500	311,993	244,437
22	うち、住宅ローン債権	—	19,347	19,432	842,066	735,146	—	19,480	19,460	842,424	735,531
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	168,381	18,398	2,965	96,513	239,676	168,481	18,523	3,793	107,643	249,694
25	相互に関係する負債がある資産	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
26	その他の資産等	352,467	63,586	16,348	107,356	467,018	405,555	36,775	21,378	59,397	495,882
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。）	—	—	—	4,649	3,951	—	—	—	3,872	3,291
29	うち、デリバティブ資産の額	—	—	—	18,854	—	—	—	—	15,300	—
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	—	—	—	2,229	2,229	—	—	—	1,290	1,290
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	352,467	63,586	16,348	81,623	460,836	405,555	36,775	21,378	38,934	491,300
32	オフ・バランス取引	—	—	—	1,386,805	68,488	—	—	—	1,389,313	68,537
33	所要安定調達額合計	—	—	—	—	4,841,892	—	—	—	—	4,844,265
34	連結安定調達比率	—	—	—	—	119.6%	—	—	—	—	120.1%

(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4四半期					2022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	691,348	—	—	—	691,348	718,247	—	—	—	718,247
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	691,348	—	—	—	691,348	718,247	—	—	—	718,247
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	4,129,101	—	—	—	3,779,397	4,151,062	—	—	—	3,800,413
5	うち、安定預金等の額	1,264,125	—	—	—	1,200,919	1,289,132	—	—	—	1,224,676
6	うち、準安定預金等の額	2,864,975	—	—	—	2,578,478	2,861,930	—	—	—	2,575,737
7	ホールセール資金調達	1,435,748	1,622,166	173,671	260,894	1,323,279	1,321,771	1,837,373	183,728	232,310	1,303,137
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	1,435,748	1,622,166	173,671	260,894	1,323,279	1,321,771	1,837,373	183,728	232,310	1,303,137
10	相互に関係する資産がある負債	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
11	その他の負債	—	155,097	—	51,091	—	—	151,343	—	27,835	—
12	うち、デリバティブ負債の額	—	—	—	44,587	—	—	—	—	25,804	—
13	うち、上記に含まれない負債の額	—	155,097	—	6,503	—	—	151,343	—	2,030	—
14	利用可能安定調達額合計	—	—	—	—	5,794,026	—	—	—	—	5,821,797
所要安定調達額 (2)											
15	流動資産の額	—	—	—	—	319,101	—	—	—	—	355,579
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	217,818	862,656	322,913	3,876,206	4,016,304	218,049	900,493	320,421	3,783,843	3,952,977
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	3,557	52,664	21,287	144,616	163,693	4,415	49,715	20,034	115,076	133,213
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。）	27,820	772,247	279,228	2,793,008	2,859,728	27,093	812,774	277,133	2,718,699	2,816,478
21	うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額	—	28,533	38,956	318,572	240,817	—	47,781	35,500	311,993	244,437
22	うち、住宅ローン債権	—	19,347	19,432	842,066	735,146	—	19,480	19,460	842,424	735,531
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	186,440	18,398	2,965	96,513	257,735	186,540	18,523	3,793	107,643	267,753
25	相互に関係する負債がある資産	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
26	その他の資産等	277,167	63,586	16,348	109,361	393,723	319,215	36,775	21,378	61,743	411,888
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。）	—	—	—	4,649	3,951	—	—	—	3,872	3,291
29	うち、デリバティブ資産の額	—	—	—	18,854	—	—	—	—	15,300	—
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	—	—	—	2,229	2,229	—	—	—	1,290	1,290
31	うち、上記に含まれない資産及び資本の額	277,167	63,586	16,348	83,628	387,542	319,215	36,775	21,378	41,280	407,306
32	オフ・バランス取引	—	—	—	1,386,805	68,488	—	—	—	1,389,313	68,537
33	所要安定調達額合計	—	—	—	—	4,797,617	—	—	—	—	4,788,982
34	単体安定調達比率	—	—	—	—	120.7%	—	—	—	—	121.5%