

## 連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（2024年3月期）

（単位：百万円、%、件）

| 項目                     |   | 当四半期                 |                      | 前四半期                 |                      |
|------------------------|---|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| <b>適格流動資産（1）</b>       |   |                      |                      |                      |                      |
| 1                      | 適格流動資産の合計額  | 4,183,866            |                      | 4,039,731            |                      |
| <b>資金流出額（2）</b>        |   | 資金流出率<br>を乗じる前<br>の額 | 資金流出率<br>を乗じた後<br>の額 | 資金流出率<br>を乗じる前<br>の額 | 資金流出率<br>を乗じた後<br>の額 |
| 2                      | リテール無担保資金調達に係る資金流出額                                 | 6,675,422            | 493,347              | 6,629,469            | 491,935              |
| 3                      | うち、安定預金の額   | 2,562,342            | 79,221               | 2,519,610            | 77,846               |
| 4                      | うち、準安定預金の額  | 4,111,856            | 414,126              | 4,108,754            | 414,089              |
| 5                      | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                               | 3,687,155            | 2,329,451            | 3,623,281            | 2,300,107            |
| 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<br>以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額 | 3,654,243            | 2,296,538            | 3,551,626            | 2,228,451            |
| 8                      | うち、負債性有価証券の額  | 32,912               | 32,912               | 71,655               | 71,655               |
| 9                      | 有担保資金調達等に係る資金流出額                                    | 21,307               |                      | 12,889               |                      |
| 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<br>性ファシリティに係る資金流出額       | 2,194,961            | 400,336              | 2,193,613            | 398,417              |
| 11                     | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                                | 187,954              | 187,954              | 185,216              | 185,216              |
| 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                             | 2,007,006            | 212,381              | 2,008,397            | 213,201              |
| 14                     | 資金提供義務に基づく資金流出額等                                    | 67,161               | 57,399               | 68,180               | 61,875               |
| 15                     | 偶発事象に係る資金流出額  | 63,788               | 1,275                | 63,602               | 1,272                |
| 16                     | 資金流出合計額   | 3,303,118            |                      | 3,266,497            |                      |
| <b>資金流入額（3）</b>        |   | 資金流入率<br>を乗じる前<br>の額 | 資金流入率<br>を乗じた後<br>の額 | 資金流入率<br>を乗じる前<br>の額 | 資金流入率<br>を乗じた後<br>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                                     | 715,264              | 411,037              | 693,724              | 401,941              |
| 19                     | その他資金流入額  | 261,576              | 219,450              | 236,960              | 198,741              |
| 20                     | 資金流入合計額   | 976,840              | 630,488              | 930,685              | 600,683              |
| <b>連結流動性カバレッジ比率（4）</b> |   |                      |                      |                      |                      |
| 21                     | 算入可能適格流動資産の合計額                                      | 4,183,866            |                      | 4,039,731            |                      |
| 22                     | 純資金流出額  | 2,672,629            |                      | 2,665,813            |                      |
| 23                     | 連結流動性カバレッジ比率  | 156.5                |                      | 151.5                |                      |
| 24                     | 平均値計算用データ数  | 58                   |                      | 62                   |                      |

## 単体流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（2024年3月期）

（単位：百万円、%、件）

| 項目                     |   | 当四半期                 |                      | 前四半期                 |                      |
|------------------------|---|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| <b>適格流動資産（1）</b>       |   |                      |                      |                      |                      |
| 1                      | 適格流動資産の合計額  | 3,864,269            |                      | 3,848,212            |                      |
| <b>資金流出額（2）</b>        |   | 資金流出率<br>を乗じる前<br>の額 | 資金流出率<br>を乗じた後<br>の額 | 資金流出率<br>を乗じる前<br>の額 | 資金流出率<br>を乗じた後<br>の額 |
| 2                      | リテール無担保資金調達に係る資金流出額                                 | 6,002,286            | 454,801              | 5,974,003            | 454,179              |
| 3                      | うち、安定預金の額   | 2,117,788            | 63,533               | 2,090,348            | 62,710               |
| 4                      | うち、準安定預金の額  | 3,883,274            | 391,267              | 3,882,550            | 391,469              |
| 5                      | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                               | 3,500,638            | 2,285,948            | 3,447,399            | 2,261,449            |
| 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<br>以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額 | 3,465,726            | 2,251,035            | 3,373,914            | 2,187,965            |
| 8                      | うち、負債性有価証券の額  | 34,912               | 34,912               | 73,484               | 73,484               |
| 9                      | 有担保資金調達等に係る資金流出額                                    | 21,307               |                      | 12,889               |                      |
| 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<br>性ファシリティに係る資金流出額       | 2,020,277            | 396,127              | 2,027,704            | 396,356              |
| 11                     | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                                | 187,954              | 187,954              | 185,216              | 185,216              |
| 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                             | 1,832,322            | 208,172              | 1,842,488            | 211,140              |
| 14                     | 資金提供義務に基づく資金流出額等                                    | 20,608               | 12,342               | 19,734               | 16,683               |
| 15                     | 偶発事象に係る資金流出額  | 52,935               | 1,058                | 53,093               | 1,061                |
| 16                     | 資金流出合計額   | 3,171,584            |                      | 3,142,621            |                      |
| <b>資金流入額（3）</b>        |   | 資金流入率<br>を乗じる前<br>の額 | 資金流入率<br>を乗じた後<br>の額 | 資金流入率<br>を乗じる前<br>の額 | 資金流入率<br>を乗じた後<br>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                                     | 723,026              | 429,617              | 700,526              | 416,134              |
| 19                     | その他資金流入額  | 256,413              | 216,099              | 228,516              | 192,356              |
| 20                     | 資金流入合計額   | 979,440              | 645,717              | 929,043              | 608,491              |
| <b>単体流動性カバレッジ比率（4）</b> |   |                      |                      |                      |                      |
| 21                     | 算入可能適格流動資産の合計額                                      | 3,864,269            |                      | 3,848,212            |                      |
| 22                     | 純資金流出額  | 2,525,867            |                      | 2,534,130            |                      |
| 23                     | 単体流動性カバレッジ比率  | 152.9                |                      | 151.8                |                      |
| 24                     | 平均値計算用データ数  | 58                   |                      | 62                   |                      |