

## 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

【連結】2022年9月期（別紙様式第四号）

（単位：百万円、％、件）

| 項目              |                                                 | 当四半期         |              | 前四半期         |              |
|-----------------|-------------------------------------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| 適格流動資産（1）       |                                                 |              |              |              |              |
| 1               | 適格流動資産の合計額                                      | 2,331,906    |              | 2,369,591    |              |
| 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                             | 5,777,376    | 452,198      | 5,722,726    | 449,944      |
| 3               | うち、安定預金の額                                       | 1,970,020    | 59,100       | 1,927,829    | 57,834       |
| 4               | うち、準安定預金の額                                      | 3,807,356    | 393,098      | 3,794,897    | 392,109      |
| 5               | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                           | 2,228,256    | 1,019,210    | 2,237,231    | 993,699      |
| 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 | 2,088,690    | 879,644      | 2,110,554    | 867,023      |
| 8               | うち、負債性有価証券の額                                    | 139,565      | 139,565      | 126,676      | 126,676      |
| 9               | 有担保資金調達等に係る資金流出額                                |              | 7,377        |              | 8,429        |
| 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       | 1,668,806    | 186,695      | 1,655,965    | 183,598      |
| 11              | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                            | 43,208       | 43,208       | 40,733       | 40,733       |
| 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                         | 1,625,598    | 143,487      | 1,615,232    | 142,865      |
| 14              | 資金提供義務等に基づく資金流出額等                               | 74,604       | 60,198       | 80,049       | 68,353       |
| 15              | 偶発事象に係る資金流出額                                    | 50,811       | 20,284       | 48,477       | 17,792       |
| 16              | 資金流出合計額                                         |              | 1,745,964    |              | 1,721,819    |
| 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                                 | 836,884      | 693,660      | 835,706      | 685,741      |
| 19              | その他資金流入額                                        | 92,488       | 78,731       | 104,291      | 81,731       |
| 20              | 資金流入合計額                                         | 929,373      | 772,391      | 939,997      | 767,473      |
| 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                                  |              | 2,331,906    |              | 2,369,591    |
| 22              | 純資金流出額                                          |              | 973,572      |              | 954,346      |
| 23              | 連結流動性カバレッジ比率                                    |              | 239.5        |              | 248.2        |
| 24              | 平均値計算用データ数                                      | 62           |              | 61           |              |

## 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

【単体】2022年9月期（別紙様式第三号）

（単位：百万円、％、件）

| 項目              |                                                 | 当四半期         |              | 前四半期         |              |
|-----------------|-------------------------------------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| 適格流動資産（1）       |                                                 |              |              |              |              |
| 1               | 適格流動資産の合計額                                      | 2,331,906    |              | 2,369,591    |              |
| 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                             | 5,777,376    | 452,198      | 5,722,726    | 449,944      |
| 3               | うち、安定預金の額                                       | 1,970,020    | 59,100       | 1,927,829    | 57,834       |
| 4               | うち、準安定預金の額                                      | 3,807,356    | 393,098      | 3,794,897    | 392,109      |
| 5               | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                           | 2,240,183    | 1,031,137    | 2,248,738    | 1,005,206    |
| 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 | 2,099,597    | 890,550      | 2,121,021    | 877,490      |
| 8               | うち、負債性有価証券の額                                    | 140,586      | 140,586      | 127,716      | 127,716      |
| 9               | 有担保資金調達等に係る資金流出額                                |              | 7,377        |              | 8,429        |
| 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       | 1,675,642    | 188,903      | 1,662,858    | 185,811      |
| 11              | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                            | 43,234       | 43,234       | 40,760       | 40,760       |
| 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                         | 1,632,408    | 145,668      | 1,622,097    | 145,051      |
| 14              | 資金提供義務等に基づく資金流出額等                               | 47,203       | 32,797       | 51,690       | 39,994       |
| 15              | 偶発事象に係る資金流出額                                    | 50,811       | 20,284       | 48,477       | 17,792       |
| 16              | 資金流出合計額                                         |              | 1,732,698    |              | 1,707,179    |
| 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                                 | 837,524      | 693,980      | 836,233      | 686,005      |
| 19              | その他資金流入額                                        | 92,520       | 78,763       | 104,322      | 81,762       |
| 20              | 資金流入合計額                                         | 930,045      | 772,743      | 940,556      | 767,768      |
| 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                                  |              | 2,331,906    |              | 2,369,591    |
| 22              | 純資金流出額                                          |              | 959,954      |              | 939,411      |
| 23              | 単体流動性カバレッジ比率                                    |              | 242.9        |              | 252.2        |
| 24              | 平均値計算用データ数                                      | 62           |              | 61           |              |