

## 連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項(2027年3月期 第1四半期)

(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                                      | 1,369,220    |              | 1,700,886    |              |
| <b>資金流出額 (2)</b>        |                                                 | 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                             | 2,279,785    | 219,480      | 2,282,957    | 219,679      |
| 3                       | うち、安定預金の額                                       | 132,272      | 3,968        | 132,547      | 3,976        |
| 4                       | うち、準安定預金の額                                      | 2,147,512    | 215,511      | 2,150,410    | 215,702      |
| 5                       | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                           | 2,822,488    | 1,067,155    | 3,075,122    | 1,303,788    |
| 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 | 2,740,143    | 984,810      | 2,880,034    | 1,108,699    |
| 8                       | うち、負債性有価証券の額                                    | 82,345       | 82,345       | 195,088      | 195,088      |
| 9                       | 有担保資金調達等に係る資金流出額                                |              | -            |              | -            |
| 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       | 736,414      | 209,157      | 682,061      | 190,706      |
| 11                      | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                            | 162,988      | 162,988      | 148,607      | 148,607      |
| 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                         | 573,426      | 46,168       | 533,454      | 42,099       |
| 14                      | 資金提供義務に基づく資金流出額等                                | 218,426      | 33,928       | 218,527      | 33,068       |
| 15                      | 偶発事象に係る資金流出額                                    | 2,096,605    | 84,318       | 2,039,579    | 78,376       |
| 16                      | 資金流出合計額                                         |              | 1,614,040    |              | 1,825,618    |
| <b>資金流入額 (3)</b>        |                                                 | 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                                 | 784,948      | 441,941      | 875,825      | 522,997      |
| 19                      | その他資金流入額                                        | 244,078      | 227,700      | 319,612      | 219,384      |
| 20                      | 資金流入合計額                                         | 1,029,026    | 669,641      | 1,195,437    | 742,381      |
| <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                                  |              | 1,369,220    |              | 1,700,886    |
| 22                      | 純資金流出額                                          |              | 944,398      |              | 1,083,236    |
| 23                      | 連結流動性カバレッジ比率                                    |              | 144.9        |              | 157.0        |
| 24                      | 平均値計算用データ数                                      | 61           |              | 58           |              |