

連結安定調達比率に関する定量的開示事項

(単位: 百万円、%)

| 項番           |                                                                                  | 当四半期<br>2026年6月末 |            |              |            |              | 前四半期<br>2026年3月末 |            |              |            |              |
|--------------|----------------------------------------------------------------------------------|------------------|------------|--------------|------------|--------------|------------------|------------|--------------|------------|--------------|
|              |                                                                                  | 算入率考慮前金額         |            |              |            | 算入率考慮<br>後金額 | 算入率考慮前金額         |            |              |            | 算入率考慮<br>後金額 |
|              |                                                                                  | 満期なし             | 6月未満       | 6月以上<br>1年未満 | 1年以上       |              | 満期なし             | 6月未満       | 6月以上<br>1年未満 | 1年以上       |              |
| 利用可能安定調達額（1） |                                                                                  |                  |            |              |            |              |                  |            |              |            |              |
| 1            | 資本の額                                                                             | 6,156,743        | -          | -            | 642,830    | 6,799,573    | 5,831,533        | -          | -            | 642,830    | 6,474,363    |
| 2            | うち、普通出資等 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 | 6,156,743        | -          | -            | 642,830    | 6,799,573    | 5,831,533        | -          | -            | 642,830    | 6,474,363    |
| 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                                                                 | 11,541           | -          | -            | -          | 10,439       | 12,288           | -          | -            | -          | 11,125       |
| 5            | うち、安定預金等の額                                                                       | 1,054            | -          | -            | -          | 1,002        | 1,316            | -          | -            | -          | 1,250        |
| 6            | うち、準安定預金等の額                                                                      | 10,486           | -          | -            | -          | 9,437        | 10,972           | -          | -            | -          | 9,874        |
| 7            | ホールセール資金調達                                                                       | 2,446,608        | 42,574,442 | 21,490,230   | 3,447,605  | 38,344,120   | 2,823,210        | 42,687,472 | 19,799,846   | 3,516,338  | 39,220,568   |
| 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                                                              | 2,446,608        | 42,574,442 | 21,490,230   | 3,447,605  | 38,344,120   | 2,823,210        | 42,687,472 | 19,799,846   | 3,516,338  | 39,220,568   |
| 10           | 相互に関係する資産がある負債                                                                   | -                | -          | -            | -          | -            | -                | -          | -            | -          | -            |
| 11           | その他の負債                                                                           | 25,183           | 3,135,288  | 128,731      | 67,491     | 70,926       | 17,701           | 3,618,345  | 43,915       | 8,814      | 28,888       |
| 12           | うち、デリバティブ負債の額                                                                    | -                | -          | -            | 67,313     | -            | -                | -          | -            | 8,805      | -            |
| 13           | うち、上記に含まれない負債の額                                                                  | 25,183           | 3,135,288  | 128,731      | 178        | 70,926       | 17,701           | 3,618,345  | 43,915       | 9          | 28,888       |
| 14           | 利用可能安定調達額合計                                                                      | -                | -          | -            | -          | 45,225,060   | -                | -          | -            | -          | 45,734,945   |
| 所要安定調達額（2）   |                                                                                  |                  |            |              |            |              |                  |            |              |            |              |
| 15           | 流動資産の額                                                                           | -                | -          | -            | -          | 1,355,778    | -                | -          | -            | -          | 1,375,202    |
| 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                                                 | 1,824            | -          | -            | -          | 912          | 1,481            | -          | -            | -          | 740          |
| 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                                             | 6,102,762        | 3,752,030  | 1,386,966    | 26,132,237 | 29,828,298   | 5,818,893        | 5,296,706  | 1,602,025    | 27,281,849 | 31,295,376   |
| 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                                             | 573,349          | 1,191,078  | 508,620      | 3,352,298  | 4,118,724    | 656,464          | 1,488,916  | 442,300      | 3,444,892  | 4,238,755    |
| 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。）                                    | 651,661          | 2,546,811  | 743,550      | 9,507,276  | 10,211,520   | 708,204          | 3,722,941  | 1,075,157    | 9,607,289  | 11,105,694   |
| 21           | うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額                                                           | -                | 541,207    | 23,074       | 343,790    | 505,605      | -                | 1,966,259  | 130,626      | 374,446    | 1,305,197    |
| 22           | うち、住宅ローン債権                                                                       | -                | 2,520      | 4,918        | 233,163    | 185,343      | -                | 2,306      | 4,795        | 231,924    | 184,017      |
| 23           | うち、リスク・ウェイトが35%以下の資産の額                                                           | -                | 1,597      | 3,157        | 82,824     | 56,213       | -                | 1,526      | 3,121        | 83,347     | 56,499       |
| 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                                                     | 4,877,752        | 11,620     | 129,876      | 13,039,499 | 15,312,710   | 4,454,224        | 82,541     | 79,772       | 13,997,742 | 15,766,908   |
| 25           | 相互に関係する負債がある資産                                                                   | -                | -          | -            | -          | -            | -                | -          | -            | -          | -            |
| 26           | その他の資産等                                                                          | 921,614          | 452,911    | 76,043       | 1,960,251  | 3,224,428    | 996,579          | 278,903    | 101,941      | 1,948,210  | 3,174,862    |
| 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。）               | -                | -          | -            | 786,217    | 669,726      | -                | -          | -            | 793,828    | 676,275      |
| 29           | うち、デリバティブ資産の額                                                                    | -                | -          | -            | -          | -            | -                | -          | -            | -          | -            |
| 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                                                   | -                | -          | -            | 40,566     | 40,566       | -                | -          | -            | 38,658     | 38,658       |
| 31           | うち、上記に含まれない資産及び資本の額                                                              | 921,614          | 452,911    | 76,043       | 1,133,467  | 2,514,135    | 996,579          | 278,903    | 101,941      | 1,115,722  | 2,459,927    |
| 32           | オフ・バランス取引                                                                        | -                | -          | -            | 11,382,718 | 346,327      | -                | -          | -            | 11,234,839 | 334,291      |
| 33           | 所要安定調達額合計                                                                        | -                | -          | -            | -          | 34,755,745   | -                | -          | -            | -          | 36,180,474   |
| 34           | 連結安定調達比率                                                                         | -                | -          | -            | -          | 130.1 %      | -                | -          | -            | -          | 126.4 %      |