

Ⅱ. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

1. 連結流動性カバレッジ比率

項 目		平成27年9月期		平成27年6月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,001,874		826,821	
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	4,428,738	365,938	4,419,364	365,331
3	うち、安定預金の額	1,109,715	33,291	1,105,747	33,172
4	うち、準安定預金の額	3,319,023	332,647	3,313,617	332,158
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,350,281	548,116	1,393,733	562,092
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	1,280,759	478,594	1,326,458	494,818
8	うち、負債性有価証券の額	69,522	69,522	67,274	67,274
9	有担保資金調達に係る資金流出額	—		—	
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	84,919	16,770	93,809	17,534
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	8,006	8,006	7,873	7,873
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	76,913	8,764	85,936	9,661
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	20,737	20,441	25,641	23,111
15	偶発事象に係る資金流出額	1,196,907	23,674	1,167,779	22,784
16	資金流出合計額	974,941		990,855	
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	293,113	168,246	301,527	184,480
19	その他資金流入額	32,716	11,206	28,857	15,695
20	資金流入合計額	325,829	179,452	330,384	200,176
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	1,001,874		826,821	
22	純資金流出額	795,489		790,678	
23	連結流動性カバレッジ比率	125.9%		104.5%	
24	平均値計算用データ数	3		3	

2. 単体流動性カバレッジ比率

項 目		平成27年9月期		平成27年6月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,001,874		826,821	
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	4,428,738	365,938	4,419,364	365,331
3	うち、安定預金の額	1,109,715	33,291	1,105,747	33,172
4	うち、準安定預金の額	3,319,023	332,647	3,313,617	332,158
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,354,413	552,248	1,398,483	566,842
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	1,284,724	482,559	1,331,208	499,568
8	うち、負債性有価証券の額	69,688	69,688	67,274	67,274
9	有担保資金調達に係る資金流出額	—		—	
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	84,919	16,770	93,809	17,534
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	8,006	8,006	7,873	7,873
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	76,913	8,764	85,936	9,661
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	526	230	4,742	2,213
15	偶発事象に係る資金流出額	1,200,241	23,674	1,171,472	22,784
16	資金流出合計額	958,862		974,706	
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	295,372	170,505	304,205	187,159
19	その他資金流入額	32,719	11,209	28,861	15,699
20	資金流入合計額	328,091	181,714	333,066	202,858
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	1,001,874		826,821	
22	純資金流出額	777,147		771,848	
23	単体流動性カバレッジ比率	128.9%		107.1%	
24	平均値計算用データ数	3		3	