

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

(単位：百万円、%、件)

項 目		平成29年9月期		平成29年6月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,141,935		1,145,704	
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	4,640,193	394,993	4,581,694	391,016
3	うち、安定預金の額	994,867	29,846	968,275	29,048
4	うち、準安定預金の額	3,645,326	365,147	3,613,418	361,968
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,492,883	607,441	1,524,030	610,060
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	1,416,898	531,456	1,454,651	540,681
8	うち、負債性有価証券の額	75,984	75,984	69,378	69,378
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		4,038		8,835
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	101,709	24,903	103,514	23,628
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	13,924	13,924	12,342	12,342
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	87,785	10,979	91,172	11,286
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	26,656	25,370	26,319	25,607
15	偶発事象に係る資金流出額	1,249,478	27,369	1,249,135	26,302
16	資金流出合計額		1,084,116		1,085,451
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	284,376	153,826	274,581	150,339
19	その他資金流入額	59,913	16,753	61,172	23,788
20	資金流入合計額	344,289	170,580	335,753	174,127
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		1,141,935		1,145,704
22	純資金流出額		913,536		911,323
23	連結流動性カバレッジ比率		125.0%		125.7%
24	平均値計算用データ数		62		62

2. 単体流動性カバレッジ比率

(単位：百万円、%、件)

項 目		平成29年9月期		平成29年6月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,141,935		1,145,704	
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	4,640,193	394,993	4,581,694	391,016
3	うち、安定預金の額	994,867	29,846	968,275	29,048
4	うち、準安定預金の額	3,645,326	365,147	3,613,418	361,968
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,500,983	615,541	1,532,073	618,104
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	1,423,113	537,671	1,461,233	547,263
8	うち、負債性有価証券の額	77,870	77,870	70,840	70,840
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	4,038		8,835	
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	101,709	24,903	103,514	23,628
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	13,924	13,924	12,342	12,342
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	87,785	10,979	91,172	11,286
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	3,925	2,639	3,199	2,488
15	偶発事象に係る資金流出額	1,254,194	27,369	1,253,655	26,302
16	資金流出合計額	1,069,485		1,070,374	
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	294,960	164,410	285,228	160,985
19	その他資金流入額	59,937	16,776	61,196	23,812
20	資金流入合計額	354,897	181,187	346,424	184,798
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	1,141,935		1,145,704	
22	純資金流出額	888,298		885,576	
23	単体流動性カバレッジ比率	128.5%		129.3%	
24	平均値計算用データ数	62		62	