

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		2018年9月期		2018年6月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,090,339		1,083,867	
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	4,750,612	402,611	4,702,120	400,176
3	うち、安定預金の額	1,043,383	31,301	1,008,892	30,266
4	うち、準安定預金の額	3,707,228	371,309	3,693,228	369,910
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,515,941	579,835	1,580,634	618,990
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	1,454,371	518,265	1,513,226	551,582
8	うち、負債性有価証券の額	61,570	61,570	67,408	67,408
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		1,604		7,354
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	108,072	23,992	107,929	24,979
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	10,297	10,297	12,069	12,069
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	97,775	13,695	95,860	12,910
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	28,478	26,985	21,441	20,549
15	偶発事象に係る資金流出額	1,241,539	28,202	1,238,901	26,366
16	資金流出合計額		1,063,232		1,098,418
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	328,586	194,505	318,719	190,646
19	その他資金流入額	27,674	10,396	40,520	21,558
20	資金流入合計額	356,260	204,901	359,239	212,204
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		1,090,339		1,083,867
22	純資金流出額		858,330		886,214
23	連結流動性カバレッジ比率		127.0%		122.3%
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		2018年9月期		2018年6月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,090,339		1,083,867	
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	4,750,612	402,611	4,702,120	400,176
3	うち、安定預金の額	1,043,383	31,301	1,008,892	30,266
4	うち、準安定預金の額	3,707,228	371,309	3,693,228	369,910
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,523,706	587,597	1,587,951	626,307
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	1,460,208	524,100	1,518,947	557,303
8	うち、負債性有価証券の額	63,497	63,497	69,003	69,003
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	1,604		7,354	
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	108,073	23,993	107,929	24,979
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	10,298	10,298	12,069	12,069
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	97,775	13,695	95,860	12,910
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	5,901	4,407	5,904	5,012
15	偶発事象に係る資金流出額	1,245,669	28,202	1,243,133	26,366
16	資金流出合計額	1,048,417		1,090,199	
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	339,209	205,128	329,985	201,912
19	その他資金流入額	27,700	10,422	40,548	21,586
20	資金流入合計額	366,909	215,551	370,533	223,498
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	1,090,339		1,083,867	
22	純資金流出額	832,865		866,701	
23	単体流動性カバレッジ比率	130.9%		125.0%	
24	平均値計算用データ数	62		62	