

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 | | 2019年9月期 | | 2019年6月期 | |
|-------------------------|---|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|
| 適格流動資産 (1) | | | | | |
| 1 | 適格流動資産の合計額 | 1,342,786 | | 1,197,115 | |
| 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 | 4,850,854 | 409,682 | 4,794,851 | 406,348 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 1,084,792 | 32,543 | 1,052,598 | 31,577 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 3,766,061 | 377,139 | 3,742,252 | 374,770 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 1,547,593 | 595,796 | 1,600,786 | 617,412 |
| 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 | 1,476,140 | 524,343 | 1,533,588 | 550,214 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 71,453 | 71,453 | 67,197 | 67,197 |
| 9 | 有担保資金調達等に係る資金流出額 | 21,083 | | 15,008 | |
| 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 | 96,842 | 19,820 | 98,816 | 19,414 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 7,030 | 7,030 | 6,257 | 6,257 |
| 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 | 89,812 | 12,790 | 92,559 | 13,157 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 27,879 | 25,010 | 30,532 | 27,545 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 1,234,013 | 33,167 | 1,237,047 | 31,918 |
| 16 | 資金流出合計額 | 1,104,560 | | 1,117,649 | |
| 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 | 278,769 | 152,131 | 282,950 | 159,828 |
| 19 | その他資金流入額 | 30,292 | 15,357 | 30,290 | 20,459 |
| 20 | 資金流入合計額 | 309,061 | 167,489 | 313,240 | 180,287 |
| 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 | 1,342,786 | | 1,197,115 | |
| 22 | 純資金流出額 | 937,071 | | 937,361 | |
| 23 | 連結流動性カバレッジ比率 | 143.2% | | 127.7% | |
| 24 | 平均値計算用データ数 | 62 | | 59 | |

2. 単体流動性カバレッジ比率

(単位：百万円、%、件)

| 項 目 | | 2019年9月期 | | 2019年6月期 | |
|-------------------------|---|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|
| 適格流動資産 (1) | | | | | |
| 1 | 適格流動資産の合計額 | 1,342,786 | | 1,197,115 | |
| 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 | 4,850,854 | 409,682 | 4,794,851 | 406,348 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 1,084,792 | 32,543 | 1,052,598 | 31,577 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 3,766,061 | 377,139 | 3,742,252 | 374,770 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 1,557,400 | 605,603 | 1,609,379 | 626,006 |
| 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 | 1,483,860 | 532,063 | 1,540,027 | 556,653 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 73,540 | 73,540 | 69,352 | 69,352 |
| 9 | 有担保資金調達等に係る資金流出額 | 21,083 | | 15,008 | |
| 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 | 96,842 | 19,820 | 98,816 | 19,414 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 7,030 | 7,030 | 6,257 | 6,257 |
| 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 | 89,812 | 12,790 | 92,559 | 13,157 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 5,123 | 2,254 | 7,057 | 4,071 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 1,237,592 | 33,167 | 1,240,796 | 31,918 |
| 16 | 資金流出合計額 | 1,091,612 | | 1,102,767 | |
| 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 | 293,776 | 167,138 | 292,091 | 168,969 |
| 19 | その他資金流入額 | 30,318 | 15,383 | 30,318 | 20,486 |
| 20 | 資金流入合計額 | 324,094 | 182,522 | 322,409 | 189,455 |
| 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 | 1,342,786 | | 1,197,115 | |
| 22 | 純資金流出額 | 909,090 | | 913,311 | |
| 23 | 単体流動性カバレッジ比率 | 147.7% | | 131.0% | |
| 24 | 平均値計算用データ数 | 62 | | 59 | |