

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28年9月期		平成28年6月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,066,138		1,073,844	
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	4,505,596	380,150	4,473,881	376,919
3	うち、安定預金の額	1,014,821	30,444	1,015,893	30,476
4	うち、準安定預金の額	3,490,775	349,705	3,457,988	346,442
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,352,196	530,745	1,387,936	535,039
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	1,287,982	466,532	1,327,385	474,488
8	うち、負債性有価証券の額	64,213	64,213	60,550	60,550
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	2,384		—	
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	92,242	27,084	86,146	21,648
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	18,040	18,040	12,769	12,769
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	74,202	9,044	73,377	8,879
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	22,625	21,743	24,115	23,530
15	偶発事象に係る資金流出額	1,223,567	23,171	1,210,898	22,782
16	資金流出合計額	985,279		979,920	
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	242,468	134,381	250,568	136,628
19	その他資金流入額	31,320	12,346	25,359	18,723
20	資金流入合計額	273,788	146,728	275,927	155,351
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	1,066,138		1,073,844	
22	純資金流出額	838,551		824,568	
23	連結流動性カバレッジ比率	127.1%		130.2%	
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

(単位：百万円、%、件)

項 目		平成28年9月期		平成28年6月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,066,138		1,073,844	
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	4,505,596	380,150	4,473,881	376,919
3	うち、安定預金の額	1,014,821	30,444	1,015,893	30,476
4	うち、準安定預金の額	3,490,775	349,705	3,457,988	346,442
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,360,337	538,886	1,395,569	542,673
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	1,294,724	473,273	1,334,485	481,589
8	うち、負債性有価証券の額	65,613	65,613	61,084	61,084
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	2,384		—	
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	92,242	27,084	86,146	21,648
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	18,040	18,040	12,769	12,769
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	74,202	9,044	73,377	8,879
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	1,985	1,102	2,446	1,862
15	偶発事象に係る資金流出額	1,227,070	23,171	1,214,731	22,782
16	資金流出合計額	972,780		965,886	
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	248,273	140,186	259,682	145,742
19	その他資金流入額	31,334	12,360	25,379	18,743
20	資金流入合計額	279,607	152,546	285,061	164,485
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	1,066,138		1,073,844	
22	純資金流出額	820,233		801,400	
23	単体流動性カバレッジ比率	129.9%		133.9%	
24	平均値計算用データ数	3		3	