

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	