

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		2020年9月期		2020年6月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,874,825		1,535,399	
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	5,164,577	433,625	4,991,474	421,009
3	うち、安定預金の額	1,190,626	35,718	1,123,661	33,709
4	うち、準安定預金の額	3,973,950	397,906	3,867,813	387,299
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,784,242	670,611	1,768,932	667,641
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	1,722,477	608,847	1,699,331	598,040
8	うち、負債性有価証券の額	61,764	61,764	69,600	69,600
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	26,518		25,309	
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	109,025	22,306	96,704	20,491
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	9,997	9,997	9,333	9,333
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	99,028	12,309	87,371	11,158
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	29,576	24,574	34,277	28,310
15	偶発事象に係る資金流出額	1,227,438	34,901	1,213,367	34,238
16	資金流出合計額	1,212,538		1,197,002	
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	281,129	154,799	347,920	224,039
19	その他資金流入額	26,663	12,094	42,698	28,278
20	資金流入合計額	307,792	166,893	390,618	252,317
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	1,874,825		1,535,399	
22	純資金流出額	1,045,644		944,684	
23	連結流動性カバレッジ比率	179.2%		162.5%	
24	平均値計算用データ数	61		61	

2. 単体流動性カバレッジ比率

(単位：百万円、%、件)

項 目		2020年9月期		2020年6月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,874,825		1,535,399	
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	5,164,577	433,625	4,991,474	421,009
3	うち、安定預金の額	1,190,626	35,718	1,123,661	33,709
4	うち、準安定預金の額	3,973,950	397,906	3,867,813	387,299
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,794,919	681,289	1,778,709	677,418
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	1,730,818	617,188	1,706,753	605,462
8	うち、負債性有価証券の額	64,100	64,100	71,956	71,956
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	26,518		25,309	
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	109,025	22,306	96,704	20,491
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	9,997	9,997	9,333	9,333
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	99,028	12,309	87,371	11,158
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	7,375	2,374	11,267	5,300
15	偶発事象に係る資金流出額	1,234,143	34,901	1,220,051	34,238
16	資金流出合計額	1,201,015		1,183,769	
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	294,384	168,053	362,964	239,083
19	その他資金流入額	26,684	12,115	42,722	28,301
20	資金流入合計額	321,068	180,169	405,686	267,385
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	1,874,825		1,535,399	
22	純資金流出額	1,020,845		916,383	
23	単体流動性カバレッジ比率	183.6%		167.5%	
24	平均値計算用データ数	61		61	