

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		2021年9月期		2021年6月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	3,130,876		3,043,526	
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	5,356,614	448,134	5,293,462	444,496
3	うち、安定預金の額	1,257,860	37,735	1,219,591	36,587
4	うち、準安定預金の額	4,098,754	410,398	4,073,870	407,909
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,314,051	1,090,659	2,356,695	1,094,018
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	2,260,685	1,037,292	2,304,644	1,041,967
8	うち、負債性有価証券の額	53,366	53,366	52,050	52,050
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	28,342		27,053	
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	129,376	29,299	13,315	31,463
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	14,793	14,793	16,726	16,726
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	114,583	14,506	116,489	14,737
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	39,439	33,794	37,068	32,688
15	偶発事象に係る資金流出額	1,293,461	35,946	1,294,047	36,034
16	資金流出合計額	1,666,176		1,665,755	
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	263,601	140,743	241,117	124,888
19	その他資金流入額	39,969	15,942	59,089	26,430
20	資金流入合計額	303,570	156,686	300,206	151,319
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	3,130,876		3,043,526	
22	純資金流出額	1,509,490		1,514,436	
23	連結流動性カバレッジ比率	207.4%		200.9%	
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		2021年9月期		2021年6月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	3,130,876		3,043,526	
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	5,356,614	448,134	5,293,462	444,496
3	うち、安定預金の額	1,257,860	37,735	1,219,591	36,587
4	うち、準安定預金の額	4,098,754	410,398	4,073,870	407,909
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,325,369	1,101,977	2,367,302	1,104,625
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	2,269,555	1,046,163	2,312,688	1,050,011
8	うち、負債性有価証券の額	55,813	55,813	54,614	54,614
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	28,342		27,053	
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	129,376	29,299	133,215	31,463
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	14,793	14,793	16,726	16,726
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	114,583	14,506	116,489	14,737
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	12,420	6,775	10,763	6,382
15	偶発事象に係る資金流出額	1,308,346	35,946	1,308,817	36,034
16	資金流出合計額	1,650,475		1,650,057	
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	277,828	154,970	254,417	138,189
19	その他資金流入額	39,990	15,963	59,111	26,452
20	資金流入合計額	317,818	170,934	313,528	164,641
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	3,130,876		3,043,526	
22	純資金流出額	1,479,541		1,485,416	
23	単体流動性カバレッジ比率	211.6%		204.8%	
24	平均値計算用データ数	61		61	