

## 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		2023年9月期		2023年6月期	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	2,858,902		2,447,629	
<b>資金流出額 (2)</b>		<b>資金流出率を乗じる前の額</b>	<b>資金流出率を乗じた後の額</b>	<b>資金流出率を乗じる前の額</b>	<b>資金流出率を乗じた後の額</b>
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	5,583,191	462,474	5,523,561	458,637
3	うち、安定預金の額	1,375,112	41,253	1,344,722	40,341
4	うち、準安定預金の額	4,208,079	421,220	4,178,838	418,296
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,343,305	1,029,730	2,272,691	912,494
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	2,294,077	980,502	2,205,420	845,223
8	うち、負債性有価証券の額	49,227	49,227	67,270	67,270
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		1,563		3,865
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	153,452	50,325	158,242	54,187
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	35,567	35,567	39,497	39,497
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	117,885	14,758	118,745	14,690
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	37,973	31,977	38,651	31,955
15	偶発事象に係る資金流出額	1,258,873	37,902	1,244,920	32,838
16	資金流出合計額		1,613,972		1,493,980
<b>資金流入額 (3)</b>		<b>資金流入率を乗じる前の額</b>	<b>資金流入率を乗じた後の額</b>	<b>資金流入率を乗じる前の額</b>	<b>資金流入率を乗じた後の額</b>
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	295,694	162,971	273,010	150,530
19	その他資金流入額	49,299	15,943	66,478	26,579
20	資金流入合計額	344,993	178,914	339,488	177,109
<b>連結流動性カバレッジ比率 (4)</b>					
21	算入可能適格流動資産の合計額		2,858,902		2,447,629
22	純資金流出額		1,435,057		1,316,870
23	連結流動性カバレッジ比率		199.2%		185.8%
24	平均値計算用データ数		62		62

## 2. 単体流動性カバレッジ比率

(単位：百万円、%、件)

項 目		2023年9月期		2023年6月期	
<b>適格流動資産</b> (1)					
1	適格流動資産の合計額	2,858,902		2,447,629	
<b>資金流出額</b> (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	5,583,191	462,474	5,523,561	458,637
3	うち、安定預金の額	1,375,112	41,253	1,344,722	40,341
4	うち、準安定預金の額	4,208,079	421,220	4,178,838	418,296
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,355,536	1,041,961	2,283,185	922,988
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	2,303,535	989,960	2,213,100	852,903
8	うち、負債性有価証券の額	52,000	52,000	70,085	70,085
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	1,563		3,865	
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	153,452	50,325	158,242	54,187
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	35,567	35,567	39,497	39,497
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	117,885	14,758	118,745	14,690
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	11,489	5,493	13,475	6,779
15	偶発事象に係る資金流出額	1,273,542	37,902	1,259,662	32,838
16	資金流出合計額	1,599,720		1,479,298	
<b>資金流入額</b> (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	309,336	176,613	286,257	163,777
19	その他資金流入額	49,323	15,967	66,500	26,601
20	資金流入合計額	358,659	192,580	352,757	190,379
<b>単体流動性カバレッジ比率</b> (4)					
21	算入可能適格流動資産の合計額	2,858,902		2,447,629	
22	純資金流出額	1,407,139		1,288,919	
23	単体流動性カバレッジ比率	203.1%		189.8%	
24	平均値計算用データ数	62		62	