

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		2024年9月期		2024年6月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	2,378,273		2,435,350	
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	5,687,756	470,204	5,633,050	467,479
3	うち、安定預金の額	1,412,560	42,376	1,373,656	41,209
4	うち、準安定預金の額	4,275,195	427,827	4,259,394	426,270
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,134,883	804,467	2,224,383	843,117
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	2,116,593	786,177	2,171,898	790,632
8	うち、負債性有価証券の額	18,290	18,290	52,485	52,485
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	—		—	
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	172,853	59,426	166,588	52,313
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	44,233	44,233	36,973	36,973
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	128,620	15,193	129,615	15,340
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	39,523	34,249	43,352	33,939
15	偶発事象に係る資金流出額	1,271,878	43,295	1,237,418	41,072
16	資金流出合計額	1,411,644		1,437,922	
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	293,293	164,045	292,197	162,468
19	その他資金流入額	31,669	11,541	43,825	20,640
20	資金流入合計額	324,962	175,587	336,022	183,108
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	2,378,273		2,435,350	
22	純資金流出額	1,236,057		1,254,814	
23	連結流動性カバレッジ比率	192.4%		194.0%	
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		2024年9月期		2024年6月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	2,378,273		2,435,350	
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	5,687,756	470,204	5,633,050	467,479
3	うち、安定預金の額	1,412,560	42,376	1,373,656	41,209
4	うち、準安定預金の額	4,275,195	427,827	4,259,394	426,270
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,148,839	818,423	2,237,004	855,738
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	2,127,797	797,381	2,181,972	800,706
8	うち、負債性有価証券の額	21,041	21,041	55,031	55,031
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	—		—	
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	172,853	59,426	166,588	52,313
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	44,233	44,233	36,973	36,973
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	128,620	15,193	129,615	15,340
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	10,879	5,606	14,494	5,080
15	偶発事象に係る資金流出額	1,285,258	43,295	1,251,603	41,072
16	資金流出合計額	1,396,957		1,421,685	
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	308,702	179,454	306,430	176,701
19	その他資金流入額	31,705	11,577	43,855	20,670
20	資金流入合計額	340,407	191,032	350,285	197,371
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	2,378,273		2,435,350	
22	純資金流出額	1,205,925		1,224,313	
23	単体流動性カバレッジ比率	197.2%		198.9%	
24	平均値計算用データ数	62		62	