

## II. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項【連結・単体共通】

### 1. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項【連結】

(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	1,757,712		1,582,766	
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	5,403,680	421,922	5,223,793	414,019
3	うち、安定預金の額	1,881,984	56,459	1,727,419	51,822
4	うち、準安定預金の額	3,521,696	365,462	3,496,373	362,197
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,886,472	821,293	1,787,203	749,088
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	1,767,153	701,974	1,662,338	624,223
8	うち、負債性有価証券の額	119,319	119,319	124,864	124,864
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		10,149		9,613
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	1,706,372	237,171	1,614,764	203,469
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	98,960	98,960	72,610	72,610
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	1,607,411	138,210	1,542,153	130,859
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	59,632	55,248	66,403	52,379
15	偶発事象に係る資金流出額	44,460	11,461	45,445	12,562
16	資金流出合計額		1,557,246		1,441,134
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	648,072	491,276	549,579	384,883
19	その他資金流入額	151,850	121,480	115,802	87,565
20	資金流入合計額	799,922	612,756	665,382	472,449
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		1,757,712		1,582,766
22	純資金流出額		944,489		968,684
23	連結流動性カバレッジ比率		186.1		163.3
24	平均値計算用データ数		61		61

2. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項【単体】

(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	1,757,712		1,582,766	
資金流出額 (2)					
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額	資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額
3	うち、安定預金の額	5,403,680	421,922	5,223,793	414,019
4	うち、準安定預金の額	1,881,984	56,459	1,727,419	51,822
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	3,521,696	365,462	3,496,373	362,197
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	1,895,597	830,418	1,796,984	758,869
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	—	—	—	—
8	うち、負債性有価証券の額	1,775,343	710,164	1,671,316	633,202
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	120,253	120,253	125,667	125,667
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	120,253	10,149	9,613	9,613
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,713,131	239,354	1,621,510	205,649
12	うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	98,969	98,969	72,616	72,616
13	うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	—	—	—	—
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	1,614,162	140,385	1,548,894	133,033
15	偶発事象に係る資金流出額	34,516	30,133	41,067	27,043
16	資金流出合計額	44,460	11,461	45,445	12,562
		1,543,438		1,427,758	
資金流入額 (3)					
17	有担保資金運用等に係る資金流入額	資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額	資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	—	—	—	—
19	その他資金流入額	648,470	491,475	549,941	385,064
20	資金流入合計額	151,863	121,493	115,812	87,575
		800,334		612,969	
		612,969		665,753	
		612,969		665,753	
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	1,757,712		1,582,766	
22	純資金流出額	930,469		955,118	
23	単体流動性カバレッジ比率	188.9		165.7	
24	平均値計算用データ数	61		61	