

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（平成28年3月期 第1四半期）

1. 連結流動性カバレッジ比率(平成27年金融庁告示第7号 別紙様式第二号)

(単位:百万円、%、件)

項目		当四半期		前四半期	
適格流動資産					
1	適格流動資産の合計額	1,239,942			
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
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	3,353,734	265,463		
3	うち、安定預金の額	1,010,588	30,317		
4	うち、準安定預金の額	2,343,145	235,145		
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	709,283	286,088		
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	684,048	260,853		
8	うち、負債性有価証券の額	25,234	25,234		
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		0		
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	1,574,049	145,934		
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	18,424	18,424		
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	1,555,625	127,510		
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	42,329	36,825		
15	偶発事象に係る資金流出額	25,091	2,450		
16	資金流出合計額		736,761		
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
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	221,106	121,575		
19	その他資金流入額	57,054	37,170		
20	資金流入合計額	278,160	158,745		
連結流動性カバレッジ比率					
21	算入可能適格流動資産の合計額		1,239,942		
22	純資金流出額		578,015		
23	連結流動性カバレッジ比率		214.5		
24	平均値計算用データ数		3		

2. 単体流動性カバレッジ比率(平成27年金融庁告示第7号 別紙様式第一号)

(単位:百万円、%、件)

項目		当四半期		前四半期	
適格流動資産					
1	適格流動資産の合計額	1,239,942			
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
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	3,353,734	265,463		
3	うち、安定預金の額	1,010,588	30,317		
4	うち、準安定預金の額	2,343,145	235,145		
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	712,535	289,340		
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	686,967	263,772		
8	うち、負債性有価証券の額	25,568	25,568		
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		0		
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	1,548,954	146,620		
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	18,424	18,424		
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	1,530,530	128,196		
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	22,614	17,109		
15	偶発事象に係る資金流出額	25,081	2,440		
16	資金流出合計額		720,974		
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
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	223,461	123,930		
19	その他資金流入額	57,055	37,171		
20	資金流入合計額	280,516	161,102		
単体流動性カバレッジ比率					
21	算入可能適格流動資産の合計額		1,239,942		
22	純資金流出額		559,871		
23	単体流動性カバレッジ比率		221.4		
24	平均値計算用データ数		3		