

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 中間期）

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	1,159,184		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	3,347,240	264,929	3,353,734	265,463
3	うち、安定預金の額	1,008,791	30,263	1,010,588	30,317
4	うち、準安定預金の額	2,338,448	234,665	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	668,529	272,287	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	649,737	253,495	684,048	260,853
8	うち、負債性有価証券の額	18,791	18,791	25,234	25,234
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		0		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	1,570,583	149,499	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	23,070	23,070	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	1,547,512	126,428	1,555,625	127,510
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	39,344	35,920	42,329	36,825
15	偶発事象に係る資金流出額	25,995	2,540	25,091	2,450
16	資金流出合計額		725,176		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	217,683	123,289	221,106	121,575
19	その他資金流入額	56,904	41,659	57,054	37,170
20	資金流入合計額	274,588	164,949	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		1,159,184		1,239,942
22	純資金流出額		560,226		578,015
23	連結流動性カバレッジ比率		206.9		214.5
24	平均値計算用データ数		3		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	1,159,184		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	3,347,240	264,929	3,353,734	265,463
3	うち、安定預金の額	1,008,791	30,263	1,010,588	30,317
4	うち、準安定預金の額	2,338,448	234,665	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	672,012	275,769	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	652,420	256,177	686,967	263,772
8	うち、負債性有価証券の額	19,591	19,591	25,568	25,568
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		0		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	1,545,873	150,201	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	23,070	23,070	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	1,522,802	127,130	1,530,530	128,196
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	19,987	16,564	22,614	17,109
15	偶発事象に係る資金流出額	25,985	2,530	25,081	2,440
16	資金流出合計額		709,994		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	220,757	126,363	223,461	123,930
19	その他資金流入額	56,913	41,669	57,055	37,171
20	資金流入合計額	277,671	168,032	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		1,159,184		1,239,942
22	純資金流出額		541,961		559,871
23	単体流動性カバレッジ比率		213.8		221.4
24	平均値計算用データ数		3		3