

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3四半期）

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	1,119,842		1,159,184	
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	3,361,934	265,496	3,347,240	264,929
3	うち、安定預金の額	1,021,876	30,656	1,008,791	30,263
4	うち、準安定預金の額	2,340,057	234,840	2,338,448	234,665
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	657,614	259,631	668,529	272,287
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	640,648	242,666	649,737	253,495
8	うち、負債性有価証券の額	16,965	16,965	18,791	18,791
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	1,580,300	155,969	1,570,583	149,499
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	28,572	28,572	23,070	23,070
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	1,551,727	127,396	1,547,512	126,428
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	40,314	37,616	39,344	35,920
15	偶発事象に係る資金流出額	26,436	2,301	25,995	2,540
16	資金流出合計額		721,015		725,176
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	253,222	140,226	217,683	123,289
19	その他資金流入額	68,663	45,326	56,904	41,659
20	資金流入合計額	321,886	185,552	274,588	164,949
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		1,119,842		1,159,184
22	純資金流出額		535,462		560,226
23	連結流動性カバレッジ比率		209.1		206.9
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	1,119,842		1,159,184	
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	3,361,934	265,496	3,347,240	264,929
3	うち、安定預金の額	1,021,876	30,656	1,008,791	30,263
4	うち、準安定預金の額	2,340,057	234,840	2,338,448	234,665
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	661,068	263,085	672,012	275,769
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	643,536	245,553	652,420	256,177
8	うち、負債性有価証券の額	17,531	17,531	19,591	19,591
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	1,557,145	157,103	1,545,873	150,201
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	28,572	28,572	23,070	23,070
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	1,528,572	128,530	1,522,802	127,130
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	20,570	17,871	19,987	16,564
15	偶発事象に係る資金流出額	26,426	2,291	25,985	2,530
16	資金流出合計額		705,849		709,994
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	255,849	142,853	220,757	126,363
19	その他資金流入額	68,665	45,327	56,913	41,669
20	資金流入合計額	324,514	188,180	277,671	168,032
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		1,119,842		1,159,184
22	純資金流出額		517,668		541,961
23	単体流動性カバレッジ比率		216.3		213.8
24	平均値計算用データ数		3		3