

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）

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	1,073,811		1,119,842	
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	3,358,624	265,166	3,361,934	265,496
3	うち、安定預金の額	1,022,389	30,671	1,021,876	30,656
4	うち、準安定預金の額	2,336,234	234,494	2,340,057	234,840
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	686,473	272,190	657,614	259,631
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	679,433	265,150	640,648	242,666
8	うち、負債性有価証券の額	7,040	7,040	16,965	16,965
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	1,578,059	156,513	1,580,300	155,969
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	30,272	30,272	28,572	28,572
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	1,547,786	126,240	1,551,727	127,396
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	30,762	24,887	40,314	37,616
15	偶発事象に係る資金流出額	27,562	2,311	26,436	2,301
16	資金流出合計額		721,070		721,015
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	230,425	129,233	253,222	140,226
19	その他資金流入額	54,673	35,028	68,663	45,326
20	資金流入合計額	285,099	164,262	321,886	185,552
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		1,073,811		1,119,842
22	純資金流出額		556,808		535,462
23	連結流動性カバレッジ比率		192.8		209.1
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	1,073,811		1,119,842	
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	3,358,624	265,166	3,361,934	265,496
3	うち、安定預金の額	1,022,389	30,671	1,021,876	30,656
4	うち、準安定預金の額	2,336,234	234,494	2,340,057	234,840
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	689,621	275,338	661,068	263,085
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	681,214	266,931	643,536	245,553
8	うち、負債性有価証券の額	8,406	8,406	17,531	17,531
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	1,555,042	157,550	1,557,145	157,103
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	30,272	30,272	28,572	28,572
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	1,524,769	127,277	1,528,572	128,530
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	8,838	2,963	20,570	17,871
15	偶発事象に係る資金流出額	27,552	2,301	26,426	2,291
16	資金流出合計額		703,320		705,849
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	233,604	132,413	255,849	142,853
19	その他資金流入額	54,682	35,036	68,665	45,327
20	資金流入合計額	288,287	167,450	324,514	188,180
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		1,073,811		1,119,842
22	純資金流出額		535,870		517,668
23	単体流動性カバレッジ比率		200.3		216.3
24	平均値計算用データ数		3		3