

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（平成29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	1,097,586		1,073,811	
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	3,369,589	265,591	3,358,624	265,166
3	うち、安定預金の額	1,031,273	30,938	1,022,389	30,671
4	うち、準安定預金の額	2,338,316	234,653	2,336,234	234,494
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	742,062	299,253	686,473	272,190
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	719,674	276,865	679,433	265,150
8	うち、負債性有価証券の額	22,387	22,387	7,040	7,040
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	1,597,543	153,940	1,578,059	156,513
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	24,067	24,067	30,272	30,272
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	1,573,476	129,873	1,547,786	126,240
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	33,668	26,992	30,762	24,887
15	偶発事象に係る資金流出額	27,032	2,202	27,562	2,311
16	資金流出合計額		747,980		721,070
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	198,137	113,902	230,425	129,233
19	その他資金流入額	58,144	29,477	54,673	35,028
20	資金流入合計額	256,282	143,379	285,099	164,262
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		1,097,586		1,073,811
22	純資金流出額		604,601		556,808
23	連結流動性カバレッジ比率		181.5		192.8
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	1,097,586		1,073,811	
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	3,369,589	265,591	3,358,624	265,166
3	うち、安定預金の額	1,031,273	30,938	1,022,389	30,671
4	うち、準安定預金の額	2,338,316	234,653	2,336,234	234,494
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	745,577	302,768	689,621	275,338
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	722,789	279,980	681,214	266,931
8	うち、負債性有価証券の額	22,787	22,787	8,406	8,406
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	1,575,316	155,134	1,555,042	157,550
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	24,067	24,067	30,272	30,272
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	1,551,248	131,066	1,524,769	127,277
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	12,277	5,601	8,838	2,963
15	偶発事象に係る資金流出額	27,023	2,192	27,552	2,301
16	資金流出合計額		731,289		703,320
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	200,708	116,472	233,604	132,413
19	その他資金流入額	58,145	29,477	54,682	35,036
20	資金流入合計額	258,853	145,950	288,287	167,450
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		1,097,586		1,073,811
22	純資金流出額		585,338		535,870
23	単体流動性カバレッジ比率		187.5		200.3
24	平均値計算用データ数		3		3