

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 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	1,057,965		1,097,586	
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	3,376,567	266,118	3,369,589	265,591
3	うち、安定預金の額	1,033,972	31,019	1,031,273	30,938
4	うち、準安定預金の額	2,342,595	235,099	2,338,316	234,653
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	759,334	334,418	742,062	299,253
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	743,887	318,972	719,674	276,865
8	うち、負債性有価証券の額	15,446	15,446	22,387	22,387
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		390		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	1,583,645	148,295	1,597,543	153,940
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	18,162	18,162	24,067	24,067
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	1,565,483	130,132	1,573,476	129,873
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	29,472	28,082	33,668	26,992
15	偶発事象に係る資金流出額	27,583	2,165	27,032	2,202
16	資金流出合計額		779,471		747,980
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	177,922	99,908	198,137	113,902
19	その他資金流入額	31,173	22,374	58,144	29,477
20	資金流入合計額	209,096	122,282	256,282	143,379
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		1,057,965		1,097,586
22	純資金流出額		657,188		604,601
23	連結流動性カバレッジ比率		160.9		181.5
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	1,057,965		1,097,586	
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	3,376,567	266,118	3,369,589	265,591
3	うち、安定預金の額	1,033,972	31,019	1,031,273	30,938
4	うち、準安定預金の額	2,342,595	235,099	2,338,316	234,653
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	763,671	338,755	745,577	302,768
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	747,325	322,409	722,789	279,980
8	うち、負債性有価証券の額	16,346	16,346	22,787	22,787
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		390		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	1,561,503	149,381	1,575,316	155,134
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	18,162	18,162	24,067	24,067
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	1,543,340	131,218	1,551,248	131,066
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	7,151	5,762	12,277	5,601
15	偶発事象に係る資金流出額	27,573	2,156	27,023	2,192
16	資金流出合計額		762,564		731,289
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	181,588	103,573	200,708	116,472
19	その他資金流入額	31,181	22,382	58,145	29,477
20	資金流入合計額	212,769	125,956	258,853	145,950
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		1,057,965		1,097,586
22	純資金流出額		636,608		585,338
23	単体流動性カバレッジ比率		166.1		187.5
24	平均値計算用データ数		3		3