

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	1,032,799		1,057,965	
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	3,397,513	267,747	3,376,567	266,118
3	うち、安定預金の額	1,040,508	31,215	1,033,972	31,019
4	うち、準安定預金の額	2,357,004	236,532	2,342,595	235,099
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	762,530	329,491	759,334	334,418
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	741,054	308,015	743,887	318,972
8	うち、負債性有価証券の額	21,475	21,475	15,446	15,446
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		0		390
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	1,600,495	160,567	1,583,645	148,295
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	29,461	29,461	18,162	18,162
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	1,571,033	131,105	1,565,483	130,132
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	34,369	29,473	29,472	28,082
15	偶発事象に係る資金流出額	26,983	1,790	27,583	2,165
16	資金流出合計額		789,069		779,471
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	220,223	123,562	177,922	99,908
19	その他資金流入額	59,401	40,698	31,173	22,374
20	資金流入合計額	279,624	164,261	209,096	122,282
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		1,032,799		1,057,965
22	純資金流出額		624,808		657,188
23	連結流動性カバレッジ比率		165.2		160.9
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	1,032,799		1,057,965	
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	3,397,575	267,753	3,376,567	266,118
3	うち、安定預金の額	1,040,510	31,215	1,033,972	31,019
4	うち、準安定預金の額	2,357,064	236,538	2,342,595	235,099
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	766,681	333,642	763,671	338,755
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	744,605	311,566	747,325	322,409
8	うち、負債性有価証券の額	22,075	22,075	16,346	16,346
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		0		390
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	1,579,136	161,832	1,561,503	149,381
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	29,461	29,461	18,162	18,162
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	1,549,674	132,370	1,543,340	131,218
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	12,944	8,048	7,151	5,762
15	偶発事象に係る資金流出額	26,973	1,781	27,573	2,156
16	資金流出合計額		773,058		762,564
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	224,212	127,551	181,588	103,573
19	その他資金流入額	59,401	40,699	31,181	22,382
20	資金流入合計額	283,614	168,250	212,769	125,956
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		1,032,799		1,057,965
22	純資金流出額		604,807		636,608
23	単体流動性カバレッジ比率		170.7		166.1
24	平均値計算用データ数		3		3