

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）

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	1,048,006		1,032,799	
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	3,428,892	269,529	3,397,513	267,747
3	うち、安定預金の額	1,059,392	31,781	1,040,508	31,215
4	うち、準安定預金の額	2,369,499	237,747	2,357,004	236,532
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	798,473	347,527	762,530	329,491
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	770,939	319,993	741,054	308,015
8	うち、負債性有価証券の額	27,534	27,534	21,475	21,475
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	1,608,834	163,185	1,600,495	160,567
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	31,760	31,760	29,461	29,461
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	1,577,074	131,425	1,571,033	131,105
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	34,521	32,214	34,369	29,473
15	偶発事象に係る資金流出額	28,307	3,156	26,983	1,790
16	資金流出合計額		815,614		789,069
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	260,887	143,816	220,223	123,562
19	その他資金流入額	69,385	48,947	59,401	40,698
20	資金流入合計額	330,273	192,764	279,624	164,261
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		1,048,006		1,032,799
22	純資金流出額		622,849		624,808
23	連結流動性カバレッジ比率		168.2		165.2
24	平均値計算用データ数		61		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	1,048,006		1,032,799	
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	3,428,982	269,538	3,397,575	267,753
3	うち、安定預金の額	1,059,395	31,781	1,040,510	31,215
4	うち、準安定預金の額	2,369,587	237,756	2,357,064	236,538
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	802,943	351,998	766,681	333,642
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	774,154	323,208	744,605	311,566
8	うち、負債性有価証券の額	28,789	28,789	22,075	22,075
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	1,587,701	164,401	1,579,136	161,832
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	31,760	31,760	29,461	29,461
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	1,555,941	132,641	1,549,674	132,370
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	11,855	9,548	12,944	8,048
15	偶発事象に係る資金流出額	28,297	3,147	26,973	1,781
16	資金流出合計額		798,634		773,058
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	265,137	148,067	224,212	127,551
19	その他資金流入額	69,391	48,953	59,401	40,699
20	資金流入合計額	334,529	197,021	283,614	168,250
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		1,048,006		1,032,799
22	純資金流出額		601,613		604,807
23	単体流動性カバレッジ比率		174.1		170.7
24	平均値計算用データ数		61		3