

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

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)

項目		平成27年度中間期		平成26年度中間期	
適格流動資産					
1	適格流動資産の合計額	1,159,184			
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	3,347,240	264,929		
3	うち、安定預金の額	1,008,791	30,263		
4	うち、準安定預金の額	2,338,448	234,665		
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	668,529	272,287		
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	649,737	253,495		
8	うち、負債性有価証券の額	18,791	18,791		
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		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	1,570,583	149,499		
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	23,070	23,070		
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	1,547,512	126,428		
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	39,344	35,920		
15	偶発事象に係る資金流出額	25,995	2,540		
16	資金流出合計額		725,176		
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	217,683	123,289		
19	その他資金流入額	56,904	41,659		
20	資金流入合計額	274,588	164,949		
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	1,159,184			
22	純資金流出額	560,226			
23	連結流動性カバレッジ比率	206.9%			
24	平均値計算用データ数	3件			

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)

項目		平成27年度中間期		平成26年度中間期	
適格流動資産					
1	適格流動資産の合計額	1,159,184			
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	3,347,240	264,929		
3	うち、安定預金の額	1,008,791	30,263		
4	うち、準安定預金の額	2,338,448	234,665		
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	672,012	275,769		
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	652,420	256,177		
8	うち、負債性有価証券の額	19,591	19,591		
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	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	1,545,873	150,201		
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	23,070	23,070		
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	1,522,802	127,130		
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	19,987	16,564		
15	偶発事象に係る資金流出額	25,985	2,530		
16	資金流出合計額	709,994			
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	220,757	126,363		
19	その他資金流入額	56,913	41,669		
20	資金流入合計額	277,671	168,032		
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	1,159,184			
22	純資金流出額	541,961			
23	単体流動性カバレッジ比率	213.8%			
24	平均値計算用データ数	3件			