

「流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項」

【連結：平成27年12月末】

(単位：百万円、%、件)

項目		当四半期		前四半期	
適格流動資産(1)					
1	適格流動資産の合計額	1,559,522		1,631,935	
資金流出額 (2)		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	4,747,989	386,272	4,718,867	384,686
3	うち、安定預金の額	1,429,832	42,894	1,408,834	42,265
4	うち、準安定預金の額	3,318,156	343,377	3,310,032	342,421
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,382,989	677,107	1,301,452	610,275
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	1,290,949	585,068	1,205,187	514,009
8	うち、負債性有価証券の額	92,039	92,039	96,265	96,265
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		50,843		50,208
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	1,527,287	240,016	1,514,787	215,580
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	120,715	120,715	95,332	95,332
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	1,406,571	119,300	1,419,454	120,248
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	43,781	34,762	32,074	30,441
15	偶発事象に係る資金流出額	41,208	10,280	41,707	10,937
16	資金流出合計額		1,399,283		1,302,129
資金流入額 (3)		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	328,790	183,000	288,746	167,596
19	その他資金流入額	192,935	136,726	152,846	114,117
20	資金流入合計額	521,725	319,726	441,593	281,714
連結流動性カバレッジ比率(4)					
21	算入可能適格流動資産の合計額		1,559,522		1,631,935
22	純資金流出額		1,079,556		1,020,415
23	連結流動性カバレッジ比率		144.4%		159.9%
24	平均値計算用データ数	3		3	

「流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項」

【単体：平成27年12月末】

(単位：百万円、%、件)

項目		当四半期		前四半期	
適格流動資産(1)					
1	適格流動資産の合計額	1,559,522		1,631,935	
資金流出額 (2)		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	4,747,989	386,272	4,718,867	384,686
3	うち、安定預金の額	1,429,832	42,894	1,408,834	42,265
4	うち、準安定預金の額	3,318,156	343,377	3,310,032	342,421
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,391,752	685,870	1,309,811	618,633
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	1,299,379	593,497	1,213,545	522,367
8	うち、負債性有価証券の額	92,373	92,373	96,265	96,265
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		50,843		50,208
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	1,533,887	242,176	1,521,398	217,752
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	120,715	120,715	95,344	95,344
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	1,413,171	121,460	1,426,054	122,408
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	18,130	9,111	6,464	4,831
15	偶発事象に係る資金流出額	41,208	10,280	41,707	10,937
16	資金流出合計額		1,384,554		1,287,050
資金流入額 (3)		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	329,192	183,201	289,097	167,772
19	その他資金流入額	192,937	136,729	152,859	114,129
20	資金流入合計額	522,130	319,930	441,956	281,902
単体流動性カバレッジ比率(4)					
21	算入可能適格流動資産の合計額		1,559,522		1,631,935
22	純資金流出額		1,064,624		1,005,147
23	単体流動性カバレッジ比率		146.4%		162.3%
24	平均値計算用データ数	3		3	