

「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28年3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	1,534,532		1,559,522	
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	4,764,565	388,200	4,747,989	386,272
3	うち、安定預金の額	1,427,367	42,821	1,429,832	42,894
4	うち、準安定預金の額	3,337,197	345,379	3,318,156	343,377
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,418,234	677,022	1,382,989	677,107
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	1,347,458	606,245	1,290,949	585,068
8	うち、負債性有価証券の額	70,776	70,776	92,039	92,039
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		58,703		50,843
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	1,500,963	207,735	1,527,287	240,016
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	87,984	87,984	120,715	120,715
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	1,412,979	119,751	1,406,571	119,300
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	55,465	34,856	43,781	34,762
15	偶発事象に係る資金流出額	42,083	9,640	41,208	10,280
16	資金流出合計額		1,376,159		1,399,283
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	302,611	168,732	328,790	183,000
19	その他資金流入額	211,218	126,360	192,935	136,726
20	資金流入合計額	513,830	295,092	521,725	319,726
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		1,534,532		1,559,522
22	純資金流出額		1,081,066		1,079,556
23	連結流動性カバレッジ比率		141.9%		144.4%
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28年3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	1,534,532		1,559,522	
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	4,764,565	388,200	4,747,989	386,272
3	うち、安定預金の額	1,427,367	42,821	1,429,832	42,894
4	うち、準安定預金の額	3,337,197	345,379	3,318,156	343,377
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,426,942	685,730	1,391,752	685,870
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	1,354,766	613,553	1,299,379	593,497
8	うち、負債性有価証券の額	72,176	72,176	92,373	92,373
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		58,703		50,843
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	1,507,583	209,915	1,533,887	242,176
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	88,004	88,004	120,715	120,715
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	1,419,579	121,911	1,413,171	121,460
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	29,813	9,204	18,130	9,111
15	偶発事象に係る資金流出額	42,083	9,640	41,208	10,280
16	資金流出合計額		1,361,394		1,384,554
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	303,330	169,092	329,192	183,201
19	その他資金流入額	211,240	126,382	192,937	136,729
20	資金流入合計額	514,571	295,474	522,130	319,930
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		1,534,532		1,559,522
22	純資金流出額		1,065,919		1,064,624
23	単体流動性カバレッジ比率		143.9%		146.4%
24	平均値計算用データ数	3		3	