

「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6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	1,595,136		1,534,532	
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	4,775,340	388,500	4,764,565	388,200
3	うち、安定預金の額	1,441,991	43,259	1,427,367	42,821
4	うち、準安定預金の額	3,333,348	345,240	3,337,197	345,379
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,485,087	680,098	1,418,234	677,022
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	1,404,832	599,843	1,347,458	606,245
8	うち、負債性有価証券の額	80,254	80,254	70,776	70,776
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		55,177		58,703
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	1,548,004	222,775	1,500,963	207,735
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	99,639	99,639	87,984	87,984
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	1,448,364	123,135	1,412,979	119,751
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	30,505	28,965	55,465	34,856
15	偶発事象に係る資金流出額	40,309	9,766	42,083	9,640
16	資金流出合計額		1,385,283		1,376,159
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	305,902	167,398	302,611	168,732
19	その他資金流入額	213,359	111,786	211,218	126,360
20	資金流入合計額	519,261	279,185	513,830	295,092
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		1,595,136		1,534,532
22	純資金流出額		1,106,097		1,081,066
23	連結流動性カバレッジ比率		144.2		141.9
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28年6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	1,595,136		1,534,532	
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	4,775,340	388,500	4,764,565	388,200
3	うち、安定預金の額	1,441,991	43,259	1,427,367	42,821
4	うち、準安定預金の額	3,333,348	345,240	3,337,197	345,379
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,493,492	688,504	1,426,942	685,730
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	1,411,421	606,432	1,354,766	613,553
8	うち、負債性有価証券の額	82,071	82,071	72,176	72,176
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		55,177		58,703
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	1,554,608	224,938	1,507,583	209,915
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	99,643	99,643	88,004	88,004
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	1,454,964	125,295	1,419,579	121,911
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	6,775	5,234	29,813	9,204
15	偶発事象に係る資金流出額	40,309	9,766	42,083	9,640
16	資金流出合計額		1,372,121		1,361,394
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	306,150	167,522	303,330	169,092
19	その他資金流入額	213,363	111,791	211,240	126,382
20	資金流入合計額	519,514	279,313	514,571	295,474
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		1,595,136		1,534,532
22	純資金流出額		1,092,808		1,065,919
23	単体流動性カバレッジ比率		145.9		143.9
24	平均値計算用データ数	3		3	