

「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9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	1,342,554		1,595,136	
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	4,776,756	387,546	4,775,340	388,500
3	うち、安定預金の額	1,458,438	43,753	1,441,991	43,259
4	うち、準安定預金の額	3,318,317	343,793	3,333,348	345,240
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,423,560	660,901	1,485,087	680,098
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	1,312,653	549,994	1,404,832	599,843
8	うち、負債性有価証券の額	110,906	110,906	80,254	80,254
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		70,738		55,177
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	1,595,046	255,161	1,548,004	222,775
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	130,679	130,679	99,639	99,639
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	1,464,367	124,482	1,448,364	123,135
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	48,884	41,429	30,505	28,965
15	偶発事象に係る資金流出額	40,997	9,082	40,309	9,766
16	資金流出合計額		1,424,859		1,385,283
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	335,453	219,976	305,902	167,398
19	その他資金流入額	231,792	132,621	213,359	111,786
20	資金流入合計額	567,245	352,598	519,261	279,185
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		1,342,554		1,595,136
22	純資金流出額		1,072,261		1,106,097
23	連結流動性カバレッジ比率		125.2		144.2
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9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	1,342,554		1,595,136	
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	4,776,756	387,546	4,775,340	388,500
3	うち、安定預金の額	1,458,438	43,753	1,441,991	43,259
4	うち、準安定預金の額	3,318,317	343,793	3,333,348	345,240
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,432,171	669,512	1,493,492	688,504
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	1,319,147	556,488	1,411,421	606,432
8	うち、負債性有価証券の額	113,023	113,023	82,071	82,071
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		70,738		55,177
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	1,601,646	257,321	1,554,608	224,938
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	130,679	130,679	99,643	99,643
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	1,470,967	126,642	1,454,964	125,295
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	25,956	18,501	6,775	5,234
15	偶発事象に係る資金流出額	40,997	9,082	40,309	9,766
16	資金流出合計額		1,412,703		1,372,121
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	336,046	220,273	306,150	167,522
19	その他資金流入額	231,793	132,622	213,363	111,791
20	資金流入合計額	567,839	352,895	519,514	279,313
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		1,342,554		1,595,136
22	純資金流出額		1,059,807		1,092,808
23	単体流動性カバレッジ比率		126.6		145.9
24	平均値計算用データ数	3		3	