

「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	1,297,671		1,342,554	
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	4,789,216	387,539	4,776,756	387,546
3	うち、安定預金の額	1,479,856	44,395	1,458,438	43,753
4	うち、準安定預金の額	3,309,359	343,144	3,318,317	343,793
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,494,714	724,516	1,423,560	660,901
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	1,382,709	612,511	1,312,653	549,994
8	うち、負債性有価証券の額	112,004	112,004	110,906	110,906
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		58,815		70,738
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	1,631,871	294,767	1,595,046	255,161
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	170,113	170,113	130,679	130,679
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	1,461,758	124,653	1,464,367	124,482
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	48,021	40,393	48,884	41,429
15	偶発事象に係る資金流出額	41,407	10,443	40,997	9,082
16	資金流出合計額		1,516,475		1,424,859
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	370,873	235,377	335,453	219,976
19	その他資金流入額	270,222	187,385	231,792	132,621
20	資金流入合計額	641,095	422,762	567,245	352,598
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		1,297,671		1,342,554
22	純資金流出額		1,093,712		1,072,261
23	連結流動性カバレッジ比率		118.6		125.2
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	1,297,671		1,342,554	
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	4,789,216	387,539	4,776,756	387,546
3	うち、安定預金の額	1,479,856	44,395	1,458,438	43,753
4	うち、準安定預金の額	3,309,359	343,144	3,318,317	343,793
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,504,429	734,231	1,432,171	669,512
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	1,389,608	619,410	1,319,147	556,488
8	うち、負債性有価証券の額	114,821	114,821	113,023	113,023
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		58,815		70,738
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	1,638,474	296,930	1,601,646	257,321
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	170,116	170,116	130,679	130,679
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	1,468,358	126,813	1,470,967	126,642
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	23,036	15,408	25,956	18,501
15	偶発事象に係る資金流出額	41,407	10,443	40,997	9,082
16	資金流出合計額		1,503,369		1,412,703
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	371,800	235,841	336,046	220,273
19	その他資金流入額	270,227	187,390	231,793	132,622
20	資金流入合計額	642,028	423,232	567,839	352,895
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		1,297,671		1,342,554
22	純資金流出額		1,080,137		1,059,807
23	単体流動性カバレッジ比率		120.1		126.6
24	平均値計算用データ数	3		3	