

Ⅱ. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項【連結・単体】

1. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項【連結】

(単位:百万円、%、件)

項目		平成29年度第1四半期 (平成29年4月1日から平成29年6月30日まで)		平成29年度第2四半期 (平成29年7月1日から平成29年9月30日まで)	
		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
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額		1,092,853		1,071,442
資金流出額 (2)					
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	4,829,125	391,276	4,882,700	393,508
3	うち、安定預金の額	1,481,559	44,446	1,528,986	45,869
4	うち、準安定預金の額	3,347,566	346,829	3,353,714	347,638
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,458,210	642,878	1,434,448	674,079
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	1,362,571	547,239	1,318,932	558,564
8	うち、負債性有価証券の額	95,638	95,638	115,515	115,515
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		71,948		56,536
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	1,652,379	313,837	1,683,501	308,032
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	189,537	189,537	179,764	179,764
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	1,462,842	124,299	1,503,737	128,268
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	80,781	67,563	66,485	55,426
15	偶発事象に係る資金流出額	47,352	14,565	47,867	14,337
16	資金流出合計額		1,502,069		1,501,921
資金流入額 (3)					
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	509,384	347,950	522,789	361,242
19	その他資金流入額	260,723	212,725	248,539	193,979
20	資金流入合計額	770,107	560,676	771,329	555,221
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		1,092,853		1,071,442
22	純資金流出額		941,393		946,699
23	連結流動性カバレッジ比率		116.0		113.1
24	平均値計算用データ数		62		62

2. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項【単体】

(単位:百万円、%、件)

項目		平成29年度第1四半期 (平成29年4月1日から平成29年6月30日まで)		平成29年度第2四半期 (平成29年7月1日から平成29年9月30日まで)	
		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
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,092,853		1,071,442	
資金流出額 (2)					
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	4,829,125	391,276	4,882,700	393,508
3	うち、安定預金の額	1,481,559	44,446	1,528,986	45,869
4	うち、準安定預金の額	3,347,566	346,829	3,353,714	347,638
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,467,431	652,099	1,443,913	683,545
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	1,371,220	555,888	1,327,974	567,605
8	うち、負債性有価証券の額	96,211	96,211	115,939	115,939
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	—	71,948	—	56,536
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	1,658,943	315,993	1,690,103	310,193
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	189,537	189,537	179,764	179,764
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	1,469,406	126,456	1,510,339	130,428
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	59,319	46,101	45,493	34,434
15	偶発事象に係る資金流出額	47,352	14,565	47,867	14,337
16	資金流出合計額	—	1,491,986	—	1,492,555
資金流入額 (3)					
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	509,564	348,041	523,100	361,397
19	その他資金流入額	260,726	212,728	248,542	193,982
20	資金流入合計額	770,290	560,769	771,643	555,380
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	—	1,092,853	—	1,071,442
22	純資金流出額	—	931,216	—	937,175
23	単体流動性カバレッジ比率	—	117.3	—	114.3
24	平均値計算用データ数	62		62	