

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27年度第1四半期 (平成27年4月1日から平成27年6月30日まで)		平成27年度第2四半期 (平成27年7月1日から平成27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
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	1,692,472		1,631,935	
<b>資金流出額 (2)</b>					
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	4,727,974	385,449	4,718,867	384,686
3	うち、安定預金の額	1,414,205	42,426	1,408,834	42,265
4	うち、準安定預金の額	3,313,769	343,022	3,310,032	342,421
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,330,857	598,871	1,301,452	610,275
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	1,258,631	526,644	1,205,187	514,009
8	うち、負債性有価証券の額	72,226	72,226	96,265	96,265
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		33,196		50,208
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	1,516,111	218,099	1,514,787	215,580
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	97,948	97,948	95,332	95,332
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	1,418,163	120,151	1,419,454	120,248
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	28,238	28,008	32,074	30,441
15	偶発事象に係る資金流出額	41,729	11,741	41,707	10,937
16	資金流出合計額		1,275,366		1,302,129
<b>資金流入額 (3)</b>					
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	333,883	202,359	288,746	167,596
19	その他資金流入額	148,655	128,436	152,846	114,117
20	資金流入合計額	482,538	330,796	441,593	281,714
<b>連結流動性カバレッジ比率 (4)</b>					
21	算入可能適格流動資産の合計額		1,692,472		1,631,935
22	純資金流出額		944,570		1,020,415
23	連結流動性カバレッジ比率		179.1%		159.9%
24	平均値計算用データ数		3		3

## 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27年度第1四半期 (平成27年4月1日から平成27年6月30日まで)		平成27年度第2四半期 (平成27年7月1日から平成27年9月30日まで)	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	1,692,472		1,631,935	
<b>資金流出額 (2)</b>					
		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	4,727,974	385,449	4,718,867	384,686
3	うち、安定預金の額	1,414,205	42,426	1,408,834	42,265
4	うち、準安定預金の額	3,313,769	343,022	3,310,032	342,421
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,338,917	606,930	1,309,811	618,633
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	1,266,690	534,703	1,213,545	522,367
8	うち、負債性有価証券の額	72,226	72,226	96,265	96,265
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	—	33,196	—	50,208
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	1,522,893	220,260	1,521,398	217,752
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	97,929	97,929	95,344	95,344
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	1,424,963	122,331	1,426,054	122,408
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	2,628	2,399	6,464	4,831
15	偶発事象に係る資金流出額	41,729	11,741	41,707	10,937
16	資金流出合計額	—	1,259,977	—	1,287,050
<b>資金流入額 (3)</b>					
		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	334,036	202,436	289,097	167,772
19	その他資金流入額	148,640	128,421	152,859	114,129
20	資金流入合計額	482,676	330,857	441,956	281,902
<b>単体流動性カバレッジ比率 (4)</b>					
21	算入可能適格流動資産の合計額	—	1,692,472	—	1,631,935
22	純資金流出額	—	929,119	—	1,005,147
23	単体流動性カバレッジ比率	—	182.1%	—	162.3%
24	平均値計算用データ数	3		3	