

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

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