

「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	1,370,374		1,071,442	
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	4,901,931	392,066	4,882,700	393,508
3	うち、安定預金の額	1,576,366	47,290	1,528,986	45,869
4	うち、準安定預金の額	3,325,565	344,775	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	1,432,227	658,173	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	1,310,646	536,591	1,318,932	558,564
8	うち、負債性有価証券の額	121,581	121,581	115,515	115,515
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		46,212		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	1,671,443	288,832	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	159,571	159,571	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	1,511,872	129,260	1,503,737	128,268
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	63,019	53,364	66,485	55,426
15	偶発事象に係る資金流出額	47,887	13,538	47,867	14,337
16	資金流出合計額		1,452,187		1,501,921
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	504,205	333,576	522,789	361,242
19	その他資金流入額	220,731	178,261	248,539	193,979
20	資金流入合計額	724,937	511,838	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		1,370,374		1,071,442
22	純資金流出額		940,348		946,699
23	連結流動性カバレッジ比率		145.7		113.1
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	1,370,374		1,071,442	
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	4,901,931	392,066	4,882,700	393,508
3	うち、安定預金の額	1,576,366	47,290	1,528,986	45,869
4	うち、準安定預金の額	3,325,565	344,775	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	1,442,349	668,294	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	1,320,241	546,186	1,327,974	567,605
8	うち、負債性有価証券の額	122,108	122,108	115,939	115,939
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		46,212		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	1,678,266	291,014	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	159,571	159,571	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	1,518,694	131,442	1,510,339	130,428
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	42,079	32,424	45,493	34,434
15	偶発事象に係る資金流出額	47,887	13,538	47,867	14,337
16	資金流出合計額		1,443,551		1,492,555
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	504,407	333,677	523,100	361,397
19	その他資金流入額	220,734	178,264	248,542	193,982
20	資金流入合計額	725,141	511,941	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		1,370,374		1,071,442
22	純資金流出額		931,609		937,175
23	単体流動性カバレッジ比率		147.0		114.3
24	平均値計算用データ数	62		62	