

「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27年6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	1,692,472			
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	4,727,974	385,449		
3	うち、安定預金の額	1,414,205	42,426		
4	うち、準安定預金の額	3,313,769	343,022		
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		
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		
8	うち、負債性有価証券の額	72,226	72,226		
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		33,196		
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		
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	97,948	97,948		
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		
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	28,238	28,008		
15	偶発事象に係る資金流出額	41,729	11,741		
16	資金流出合計額		1,275,366		
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	333,883	202,359		
19	その他資金流入額	148,655	128,436		
20	資金流入合計額	482,538	330,796		
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		1,692,472		
22	純資金流出額		944,570		
23	連結流動性カバレッジ比率		179.1%		
24	平均値計算用データ数	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27年6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	1,692,472			
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	4,727,974	385,449		
3	うち、安定預金の額	1,414,205	42,426		
4	うち、準安定預金の額	3,313,769	343,022		
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	655,216		
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		
8	うち、負債性有価証券の額	72,226	72,226		
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		33,196		
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		
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	97,929	97,929		
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		
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	2,628	2,399		
15	偶発事象に係る資金流出額	41,729	11,741		
16	資金流出合計額		1,259,977		
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	334,036	202,436		
19	その他資金流入額	148,640	128,421		
20	資金流入合計額	482,676	330,857		
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		1,692,472		
22	純資金流出額		929,119		
23	単体流動性カバレッジ比率		182.1%		
24	平均値計算用データ数	3			