

「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	1,631,935		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	4,718,867	384,686	4,727,974	385,449
3	うち、安定預金の額	1,408,834	42,265	1,414,205	42,426
4	うち、準安定預金の額	3,310,032	342,421	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	1,301,452	610,275	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	1,205,187	514,009	1,258,631	526,644
8	うち、負債性有価証券の額	96,265	96,265	72,226	72,226
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		50,208		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	1,514,787	215,580	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	95,332	95,332	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	1,419,454	120,248	1,418,163	120,151
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	32,074	30,441	28,238	28,008
15	偶発事象に係る資金流出額	41,707	10,937	41,729	11,741
16	資金流出合計額		1,302,129		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	288,746	167,596	333,883	202,359
19	その他資金流入額	152,846	114,117	148,655	128,436
20	資金流入合計額	441,593	281,714	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		1,631,935		1,692,472
22	純資金流出額		1,020,415		944,570
23	連結流動性カバレッジ比率		159.9%		179.1%
24	平均値計算用データ数	3		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	1,631,935		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	4,718,867	384,686	4,727,974	385,449
3	うち、安定預金の額	1,408,834	42,265	1,414,205	42,426
4	うち、準安定預金の額	3,310,032	342,421	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	1,309,811	618,633	1,338,917	606,930
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	1,213,545	522,367	1,266,690	534,703
8	うち、負債性有価証券の額	96,265	96,265	72,226	72,226
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		50,208		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	1,521,398	217,752	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	95,344	95,344	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	1,426,054	122,408	1,424,963	122,331
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	6,464	4,831	2,628	2,399
15	偶発事象に係る資金流出額	41,707	10,937	41,729	11,741
16	資金流出合計額		1,287,050		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	289,097	167,772	334,036	202,436
19	その他資金流入額	152,859	114,129	148,640	128,421
20	資金流入合計額	441,956	281,902	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		1,631,935		1,692,472
22	純資金流出額		1,005,147		929,119
23	単体流動性カバレッジ比率		162.3%		182.1%
24	平均値計算用データ数	3		3	