

Ⅲ. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項【連結・単体共通】

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28年度第3四半期 (平成28年10月1日から平成28年12月31日まで)		平成28年度第4四半期 (平成29年1月1日から平成29年3月31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
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額		1,297,671		1,159,304
資金流出額 (2)					
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	4,789,216	387,539	4,813,237	388,504
3	うち、安定預金の額	1,479,856	44,395	1,496,001	44,880
4	うち、準安定預金の額	3,309,359	343,144	3,317,236	343,624
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,494,714	724,516	1,439,381	698,807
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	1,382,709	612,511	1,299,884	559,310
8	うち、負債性有価証券の額	112,004	112,004	139,497	139,497
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		58,815		60,926
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	1,631,871	294,767	1,669,283	343,819
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	170,113	170,113	220,012	220,012
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	1,461,758	124,653	1,449,270	123,806
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	48,021	40,393	63,473	53,863
15	偶発事象に係る資金流出額	41,407	10,443	43,751	12,174
16	資金流出合計額		1,516,475		1,558,096
資金流入額 (3)					
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	370,873	235,377	471,265	310,314
19	その他資金流入額	270,222	187,385	289,519	239,419
20	資金流入合計額	641,095	422,762	760,784	549,733
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		1,297,671		1,159,304
22	純資金流出額		1,093,712		1,008,362
23	連結流動性カバレッジ比率		118.6		114.9
24	平均値計算用データ数		3		61

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28年度第3四半期 (平成28年10月1日から平成28年12月31日まで)		平成28年度第4四半期 (平成29年1月1日から平成29年3月31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
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	1,297,671		1,159,304	
資金流出額 (2)					
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	4,789,216	387,539	4,813,237	388,504
3	うち、安定預金の額	1,479,856	44,395	1,496,001	44,880
4	うち、準安定預金の額	3,309,359	343,144	3,317,236	343,624
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,504,429	734,231	1,451,926	711,353
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	1,389,608	619,410	1,308,953	568,379
8	うち、負債性有価証券の額	114,821	114,821	142,973	142,973
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	—	58,815	—	60,926
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	1,638,474	296,930	1,675,662	345,890
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	170,116	170,116	220,012	220,012
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	1,468,358	126,813	1,455,649	125,878
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	23,036	15,408	39,420	29,809
15	偶発事象に係る資金流出額	41,407	10,443	43,751	12,174
16	資金流出合計額	—	1,503,369	—	1,548,659
資金流入額 (3)					
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	371,800	235,841	472,552	311,069
19	その他資金流入額	270,227	187,390	289,522	239,421
20	資金流入合計額	642,028	423,232	762,075	550,491
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	—	1,297,671	—	1,159,304
22	純資金流出額	—	1,080,137	—	998,168
23	単体流動性カバレッジ比率	—	120.1	—	116.1
24	平均値計算用データ数	3		61	