

「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3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	1,159,304		1,297,671	
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	4,813,237	388,504	4,789,216	387,539
3	うち、安定預金の額	1,496,001	44,880	1,479,856	44,395
4	うち、準安定預金の額	3,317,236	343,624	3,309,359	343,144
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,439,381	698,807	1,494,714	724,516
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	1,299,884	559,310	1,382,709	612,511
8	うち、負債性有価証券の額	139,497	139,497	112,004	112,004
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		60,926		58,815
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	1,669,283	343,819	1,631,871	294,767
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	220,012	220,012	170,113	170,113
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	1,449,270	123,806	1,461,758	124,653
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	63,473	53,863	48,021	40,393
15	偶発事象に係る資金流出額	43,751	12,174	41,407	10,443
16	資金流出合計額		1,558,096		1,516,475
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	471,265	310,314	370,873	235,377
19	その他資金流入額	289,519	239,419	270,222	187,385
20	資金流入合計額	760,784	549,733	641,095	422,762
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		1,159,304		1,297,671
22	純資金流出額		1,008,362		1,093,712
23	連結流動性カバレッジ比率		114.9		118.6
24	平均値計算用データ数	61		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29年3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	1,159,304		1,297,671	
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	4,813,237	388,504	4,789,216	387,539
3	うち、安定預金の額	1,496,001	44,880	1,479,856	44,395
4	うち、準安定預金の額	3,317,236	343,624	3,309,359	343,144
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,451,926	711,353	1,504,429	734,231
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	1,308,953	568,379	1,389,608	619,410
8	うち、負債性有価証券の額	142,973	142,973	114,821	114,821
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		60,926		58,815
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	1,675,662	345,890	1,638,474	296,930
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	220,012	220,012	170,116	170,116
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	1,455,649	125,878	1,468,358	126,813
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	39,420	29,809	23,036	15,408
15	偶発事象に係る資金流出額	43,751	12,174	41,407	10,443
16	資金流出合計額		1,548,659		1,503,369
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	472,552	311,069	371,800	235,841
19	その他資金流入額	289,522	239,421	270,227	187,390
20	資金流入合計額	762,075	550,491	642,028	423,232
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		1,159,304		1,297,671
22	純資金流出額		998,168		1,080,137
23	単体流動性カバレッジ比率		116.1		120.1
24	平均値計算用データ数	61		3	