

「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	1,092,853		1,159,304	
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	4,829,125	391,276	4,813,237	388,504
3	うち、安定預金の額	1,481,559	44,446	1,496,001	44,880
4	うち、準安定預金の額	3,347,566	346,829	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	1,458,210	642,878	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	1,362,571	547,239	1,299,884	559,310
8	うち、負債性有価証券の額	95,638	95,638	139,497	139,497
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		71,948		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	1,652,379	313,837	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	189,537	189,537	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	1,462,842	124,299	1,449,270	123,806
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	80,781	67,563	63,473	53,863
15	偶発事象に係る資金流出額	47,352	14,565	43,751	12,174
16	資金流出合計額		1,502,069		1,558,096
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	509,384	347,950	471,265	310,314
19	その他資金流入額	260,723	212,725	289,519	239,419
20	資金流入合計額	770,107	560,676	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		1,092,853		1,159,304
22	純資金流出額		941,393		1,008,362
23	連結流動性カバレッジ比率		116.0		114.9
24	平均値計算用データ数	62		61	

「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	1,092,853		1,159,304	
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	4,829,125	391,276	4,813,237	388,504
3	うち、安定預金の額	1,481,559	44,446	1,496,001	44,880
4	うち、準安定預金の額	3,347,566	346,829	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	1,467,431	652,099	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	1,371,220	555,888	1,308,953	568,379
8	うち、負債性有価証券の額	96,211	96,211	142,973	142,973
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		71,948		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	1,658,943	315,993	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	189,537	189,537	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	1,469,406	126,456	1,455,649	125,878
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	59,319	46,101	39,420	29,809
15	偶発事象に係る資金流出額	47,352	14,565	43,751	12,174
16	資金流出合計額		1,491,986		1,548,659
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	509,564	348,041	472,552	311,069
19	その他資金流入額	260,726	212,728	289,522	239,421
20	資金流入合計額	770,290	560,769	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		1,092,853		1,159,304
22	純資金流出額		931,216		998,168
23	単体流動性カバレッジ比率		117.3		116.1
24	平均値計算用データ数	62		61	