

〈流動性カバレッジ比率に関する開示事項〉(平成29年3月期 第3四半期)

1. 連結流動性カバレッジ比率

(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	801,677		789,094	
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	2,439,486	192,621	2,426,407	192,284
3	うち、安定預金の額	743,444	22,303	729,483	21,884
4	うち、準安定預金の額	1,696,041	170,318	1,696,923	170,399
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	809,341	465,122	689,596	347,224
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	751,286	407,067	646,300	303,929
8	うち、負債性有価証券の額	58,054	58,054	43,295	43,295
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		4,371		3,675
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	51,927	39,715	39,453	27,340
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	37,980	37,980	25,616	25,616
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	13,946	1,734	13,836	1,723
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	33,042	17,637	40,004	13,694
15	偶発事象に係る資金流出額	523,153	15,480	521,318	15,441
16	資金流出合計額		734,949		599,661
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	106,289	97,222	79,377	65,108
19	その他資金流入額	145,168	92,792	111,846	66,141
20	資金流入合計額		190,014		131,250
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		801,677		789,094
22	純資金流出額		544,935		468,411
23	連結流動性カバレッジ比率		147.1		168.4
24	平均値計算用データ数	3		3	

上記は、平成27年金融庁告示第7号の別紙様式第2号に基づく開示事項です。

2. 単体流動性カバレッジ比率

(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	801,677		789,094	
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	2,439,486	192,621	2,426,407	192,284
3	うち、安定預金の額	743,444	22,303	729,483	21,884
4	うち、準安定預金の額	1,696,041	170,318	1,696,923	170,399
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	810,825	466,606	691,678	349,307
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	752,770	408,552	648,383	306,011
8	うち、負債性有価証券の額	58,054	58,054	43,295	43,295
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		4,371		3,675
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	51,927	39,715	39,453	27,340
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	37,980	37,980	25,616	25,616
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	13,946	1,734	13,836	1,723
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	31,278	16,972	38,293	12,531
15	偶発事象に係る資金流出額	500,894	14,836	498,977	14,774
16	資金流出合計額		735,124		599,914
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	102,484	95,040	76,381	63,751
19	その他資金流入額	145,176	92,800	111,853	66,149
20	資金流入合計額		187,840		129,900
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		801,677		789,094
22	純資金流出額		547,284		470,013
23	単体流動性カバレッジ比率		146.4		167.8
24	平均値計算用データ数	3		3	

上記は、平成27年金融庁告示第7号の別紙様式第1号に基づく開示事項です。