

〈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2四半期)

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	789,094		777,151	
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	2,426,407	192,284	2,415,871	191,976
3	うち、安定預金の額	729,483	21,884	718,677	21,560
4	うち、準安定預金の額	1,696,923	170,399	1,697,194	170,416
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	689,596	347,224	671,718	299,621
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	646,300	303,929	644,936	272,838
8	うち、負債性有価証券の額	43,295	43,295	26,782	26,782
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		3,675		8,838
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	39,453	27,340	43,579	28,605
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	25,616	25,616	26,574	26,574
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	13,836	1,723	17,004	2,030
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	40,004	13,694	25,853	10,815
15	偶発事象に係る資金流出額	521,318	15,441	521,163	15,418
16	資金流出合計額		599,661		555,276
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	79,377	65,108	47,584	36,697
19	その他資金流入額	111,846	66,141	131,596	81,825
20	資金流入合計額		131,250		118,522
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		789,094		777,151
22	純資金流出額		468,411		436,753
23	連結流動性カバレッジ比率		168.4		178.4
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	789,094		777,151	
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	2,426,407	192,284	2,415,871	191,976
3	うち、安定預金の額	729,483	21,884	718,677	21,560
4	うち、準安定預金の額	1,696,923	170,399	1,697,194	170,416
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	691,678	349,307	673,200	301,103
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	648,383	306,011	646,417	274,320
8	うち、負債性有価証券の額	43,295	43,295	26,782	26,782
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		3,675		8,838
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	39,453	27,340	43,579	28,605
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	25,616	25,616	26,574	26,574
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	13,836	1,723	17,004	2,030
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	38,293	12,531	25,853	9,552
15	偶発事象に係る資金流出額	498,977	14,774	498,114	14,750
16	資金流出合計額		599,914		554,826
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	76,381	63,751	43,673	34,480
19	その他資金流入額	111,853	66,149	131,529	81,796
20	資金流入合計額		129,900		116,276
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		789,094		777,151
22	純資金流出額		470,013		438,549
23	単体流動性カバレッジ比率		167.8		177.6
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。