

連結流動性カバレッジ比率に関する開示事項

(単位：百万円、%、件)

項目		平成29年度第2四半期		平成29年度第1四半期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	750,247		725,618	
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	2,511,836	207,157	2,500,229	206,796
3	うち、安定預金の額	638,688	19,160	627,110	18,813
4	うち、準安定預金の額	1,873,147	187,996	1,873,119	187,982
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	597,027	234,924	577,396	221,152
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	581,949	219,846	559,919	203,675
8	うち、負債性有価証券の額	15,077	15,077	17,477	17,477
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		—		—
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	803,978	88,392	796,936	80,392
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	32,295	32,295	24,164	24,164
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	771,682	56,096	772,771	56,227
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	31,901	24,763	33,443	25,368
15	偶発事象に係る資金流出額	8,286	179	8,514	170
16	資金流出合計額		555,417		533,880
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	225,093	122,301	232,942	131,355
19	その他資金流入額	72,157	64,480	58,611	51,200
20	資金流入合計額	297,250	186,781	291,553	182,555
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		750,247		725,618
22	純資金流出額		368,636		351,324
23	連結流動性カバレッジ比率		203.5		206.5
24	平均値計算用データ数	62		62	

単体流動性カバレッジ比率に関する開示事項

(単位：百万円、%、件)

項目		平成29年度第2四半期		平成29年度第1四半期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	750,247		725,618	
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	2,511,836	207,157	2,500,229	206,796
3	うち、安定預金の額	638,688	19,160	627,110	18,813
4	うち、準安定預金の額	1,873,147	187,996	1,873,119	187,982
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	604,213	242,110	584,046	227,802
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	589,135	227,032	566,568	210,324
8	うち、負債性有価証券の額	15,077	15,077	17,477	17,477
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		—		—
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	797,050	90,161	790,331	82,358
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	32,295	32,295	24,164	24,164
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	764,755	57,865	766,166	58,193
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	9,906	2,769	11,919	3,844
15	偶発事象に係る資金流出額	8,286	179	8,514	170
16	資金流出合計額		542,377		520,971
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	230,436	127,644	237,876	136,289
19	その他資金流入額	72,158	64,481	58,612	51,201
20	資金流入合計額	302,594	192,125	296,488	187,490
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		750,247		725,618
22	純資金流出額		350,252		333,481
23	単体流動性カバレッジ比率		214.2		217.5
24	平均値計算用データ数	62		62	