

単体流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（29年9月期）

（27年2月27日金融庁告示7号 別紙様式第一号）

（単位：百万円、%、件）

項目		当四半期		前四半期	
<b>適格流動資産（1）</b>					
1	適格流動資産の合計額	1,603,210		1,620,772	
<b>資金流出額（2）</b>		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	4,836,173	374,718	4,772,827	370,914
3	うち、安定預金の額	1,628,576	48,857	1,590,683	47,720
4	うち、準安定預金の額	3,206,971	325,861	3,181,557	323,194
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,383,220	635,755	1,432,730	658,582
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	1,205,685	458,220	1,219,627	445,479
8	うち、負債性有価証券の額	177,535	177,535	213,102	213,102
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		5,170		5,753
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	2,022,230	343,210	2,082,667	368,084
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	127,249	127,249	145,256	145,256
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	1,894,980	215,961	1,937,411	222,827
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	34,260	18,653	23,603	11,006
15	偶発事象に係る資金流出額	31,870	637	33,296	665
16	資金流出合計額		1,378,147		1,415,007
<b>資金流入額（3）</b>		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	619,673	402,737	536,406	345,972
19	その他資金流入額	236,348	177,027	241,510	192,524
20	資金流入合計額	856,022	579,765	777,916	538,497
<b>単体流動性カバレッジ比率（4）</b>					
21	算入可能適格流動資産の合計額		1,603,210		1,620,772
22	純資金流出額		798,382		876,510
23	単体流動性カバレッジ比率		200.8%		184.9%
24	平均値計算用データ数		62		62

連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（29年9月期）

（27年2月27日金融庁告示7号 別紙様式第二号）

（単位：百万円、%、件）

項目		当四半期		前四半期	
<b>適格流動資産（1）</b>					
1	適格流動資産の合計額	1,603,210		1,620,772	
<b>資金流出額（2）</b>		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	4,836,170	374,718	4,772,824	370,914
3	うち、安定預金の額	1,628,576	48,857	1,590,683	47,720
4	うち、準安定預金の額	3,206,968	325,861	3,181,554	323,193
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,369,854	622,389	1,424,757	650,609
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	1,194,545	447,080	1,211,692	437,543
8	うち、負債性有価証券の額	175,308	175,308	213,065	213,065
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		5,170		5,753
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	1,993,951	331,899	2,053,346	356,356
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	127,249	127,249	145,256	145,256
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	1,866,701	204,649	1,908,089	211,099
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	65,197	49,590	54,737	42,140
15	偶発事象に係る資金流出額	31,870	637	33,296	665
16	資金流出合計額		1,384,406		1,426,440
<b>資金流入額（3）</b>		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	587,887	371,197	512,324	322,109
19	その他資金流入額	236,333	177,012	241,498	192,512
20	資金流入合計額	824,221	548,210	753,823	514,621
<b>連結流動性カバレッジ比率（4）</b>					
21	算入可能適格流動資産の合計額		1,603,210		1,620,772
22	純資金流出額		836,196		911,818
23	連結流動性カバレッジ比率		191.7%		177.7%
24	平均値計算用データ数		62		62