

## 連結流動性カバレッジ比率に関する開示事項（平成29年3月末）

（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	727,514		786,813	
<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	2,496,692	205,833	2,492,979	205,860
3	うち、安定預金の額	635,370	19,061	630,310	18,909
4	うち、準安定預金の額	1,861,322	186,772	1,862,668	186,951
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	567,696	219,004	580,332	221,828
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	552,454	203,762	563,399	204,895
8	うち、負債性有価証券の額	15,242	15,242	16,933	16,933
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	784,577	75,008	771,754	71,710
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	19,823	19,823	17,725	17,725
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	764,754	55,185	754,028	53,984
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	29,741	24,137	23,299	21,370
15	偶発事象に係る資金流出額	8,272	166	8,169	164
16	資金流出合計額		524,150		520,934
<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	238,097	132,295	195,203	104,660
19	その他資金流入額	60,343	53,109	55,658	45,060
20	資金流入合計額	298,440	185,404	250,862	149,720
<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		727,514		786,813
22	純資金流出額		338,746		371,214
23	連結流動性カバレッジ比率		214.7		211.9
24	平均値計算用データ数	61		3	

## 単体流動性カバレッジ比率に関する開示事項（平成29年3月末）

（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	727,514		786,813	
<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	2,496,692	205,833	2,492,979	205,860
3	うち、安定預金の額	635,370	19,061	630,310	18,909
4	うち、準安定預金の額	1,861,322	186,772	1,862,668	186,951
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	574,126	225,434	586,995	228,491
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	558,884	210,192	570,061	211,557
8	うち、負債性有価証券の額	15,242	15,242	16,933	16,933
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	776,903	76,614	763,251	73,017
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	19,823	19,823	17,725	17,725
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	757,079	56,791	745,525	55,291
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	9,081	3,478	3,552	1,623
15	偶発事象に係る資金流出額	8,272	166	8,169	164
16	資金流出合計額		511,526		509,157
<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	243,973	138,170	198,406	107,863
19	その他資金流入額	60,344	53,110	55,659	45,061
20	資金流入合計額	304,317	191,281	254,066	152,924
<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		727,514		786,813
22	純資金流出額		320,245		356,233
23	単体流動性カバレッジ比率		227.1		220.8
24	平均値計算用データ数	61		3	