

## 連結流動性カバレッジ比率に関する開示事項（平成28年6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	807,069		793,684	
<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	2,463,712	205,015	2,461,248	204,281
3	うち、安定預金の額	600,108	18,003	606,480	18,194
4	うち、準安定預金の額	1,863,604	187,011	1,854,767	186,086
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	562,332	211,720	532,342	194,685
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	549,565	198,953	519,545	181,888
8	うち、負債性有価証券の額	12,766	12,766	12,796	12,796
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	783,252	77,952	769,757	74,063
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	24,144	24,144	21,059	21,059
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	759,108	53,808	748,698	53,004
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	20,266	18,101	24,006	22,264
15	偶発事象に係る資金流出額	8,558	171	8,497	169
16	資金流出合計額		512,960		495,464
<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	202,521	113,044	211,358	117,670
19	その他資金流入額	75,284	63,615	65,243	55,153
20	資金流入合計額	277,805	176,660	276,602	172,823
<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		807,069		793,684
22	純資金流出額		336,300		322,640
23	連結流動性カバレッジ比率		239.9		245.9
24	平均値計算用データ数	3		3	

## 単体流動性カバレッジ比率に関する開示事項（平成28年6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	807,069		793,684	
<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	2,463,712	205,015	2,461,248	204,281
3	うち、安定預金の額	600,108	18,003	606,480	18,194
4	うち、準安定預金の額	1,863,604	187,011	1,854,767	186,086
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	568,923	218,311	538,561	200,805
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	556,156	205,544	525,764	188,008
8	うち、負債性有価証券の額	12,766	12,766	12,796	12,796
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	773,693	78,957	758,986	74,655
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	24,144	24,144	21,059	21,059
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	749,548	54,812	737,927	53,596
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	3,144	979	3,148	1,406
15	偶発事象に係る資金流出額	8,558	171	8,497	169
16	資金流出合計額		503,434		481,318
<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	204,946	115,469	214,678	120,990
19	その他資金流入額	75,284	63,616	65,245	55,154
20	資金流入合計額	280,231	179,085	279,923	176,145
<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		807,069		793,684
22	純資金流出額		324,348		305,173
23	単体流動性カバレッジ比率		248.8		260.0
24	平均値計算用データ数	3		3	