

連結流動性カバレッジ比率に関する開示事項（平成28年9月末）

（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	793,838		807,069	
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	2,472,192	205,005	2,463,712	205,015
3	うち、安定預金の額	612,830	18,384	600,108	18,003
4	うち、準安定預金の額	1,859,362	186,620	1,863,604	187,011
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	553,853	206,799	562,332	211,720
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	538,866	191,811	549,565	198,953
8	うち、負債性有価証券の額	14,987	14,987	12,766	12,766
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	772,292	73,715	783,252	77,952
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	19,825	19,825	24,144	24,144
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	752,466	53,890	759,108	53,808
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	19,086	17,585	20,266	18,101
15	偶発事象に係る資金流出額	8,428	168	8,558	171
16	資金流出合計額		503,274		512,960
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	180,393	97,814	202,521	113,044
19	その他資金流入額	66,219	55,142	75,284	63,615
20	資金流入合計額	246,613	152,957	277,805	176,660
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		793,838		807,069
22	純資金流出額		350,317		336,300
23	連結流動性カバレッジ比率		226.6		239.9
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9月末）

（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	793,838		807,069	
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	2,472,192	205,005	2,463,712	205,015
3	うち、安定預金の額	612,830	18,384	600,108	18,003
4	うち、準安定預金の額	1,859,362	186,620	1,863,604	187,011
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	560,255	213,201	568,923	218,311
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	545,268	198,213	556,156	205,544
8	うち、負債性有価証券の額	14,987	14,987	12,766	12,766
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	764,377	75,318	773,693	78,957
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	19,825	19,825	24,144	24,144
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	744,551	55,492	749,548	54,812
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	1,874	374	3,144	979
15	偶発事象に係る資金流出額	8,428	168	8,558	171
16	資金流出合計額	494,067		503,434	
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	182,318	99,739	204,946	115,469
19	その他資金流入額	66,220	55,142	75,284	63,616
20	資金流入合計額	248,538	154,882	280,231	179,085
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	793,838		807,069	
22	純資金流出額	339,184		324,348	
23	単体流動性カバレッジ比率	234.0		248.8	
24	平均値計算用データ数	3		3	