

連結流動性カバレッジ比率に関する開示事項（平成28年12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	786,813		793,838	
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	2,492,979	205,860	2,472,192	205,005
3	うち、安定預金の額	630,310	18,909	612,830	18,384
4	うち、準安定預金の額	1,862,668	186,951	1,859,362	186,620
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	580,332	221,828	553,853	206,799
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	563,399	204,895	538,866	191,811
8	うち、負債性有価証券の額	16,933	16,933	14,987	14,987
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	771,754	71,710	772,292	73,715
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	17,725	17,725	19,825	19,825
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	754,028	53,984	752,466	53,890
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	23,299	21,370	19,086	17,585
15	偶発事象に係る資金流出額	8,169	164	8,428	168
16	資金流出合計額		520,934		503,274
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	195,203	104,660	180,393	97,814
19	その他資金流入額	55,658	45,060	66,219	55,142
20	資金流入合計額	250,862	149,720	246,613	152,957
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		786,813		793,838
22	純資金流出額		371,214		350,317
23	連結流動性カバレッジ比率		211.9		226.6
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12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	786,813		793,838	
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	2,492,979	205,860	2,472,192	205,005
3	うち、安定預金の額	630,310	18,909	612,830	18,384
4	うち、準安定預金の額	1,862,668	186,951	1,859,362	186,620
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	586,995	228,491	560,255	213,201
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	570,061	211,557	545,268	198,213
8	うち、負債性有価証券の額	16,933	16,933	14,987	14,987
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	763,251	73,017	764,377	75,318
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	17,725	17,725	19,825	19,825
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	745,525	55,291	744,551	55,492
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	3,552	1,623	1,874	374
15	偶発事象に係る資金流出額	8,169	164	8,428	168
16	資金流出合計額		509,157		494,067
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	198,406	107,863	182,318	99,739
19	その他資金流入額	55,659	45,061	66,220	55,142
20	資金流入合計額	254,066	152,924	248,538	154,882
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		786,813		793,838
22	純資金流出額		356,233		339,184
23	単体流動性カバレッジ比率		220.8		234.0
24	平均値計算用データ数	3		3	