

Ⅱ. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項【連結・単体】

1. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項【連結】

(単位:百万円、%、件)

項目		平成28年度第1四半期 (平成28年4月1日から平成28年6月30日まで)		平成28年度第2四半期 (平成28年7月1日から平成28年9月30日まで)	
		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
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額		1,595,136		1,342,554
<b>資金流出額 (2)</b>					
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	4,775,340	388,500	4,776,756	387,546
3	うち、安定預金の額	1,441,991	43,259	1,458,438	43,753
4	うち、準安定預金の額	3,333,348	345,240	3,318,317	343,793
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,485,087	680,098	1,423,560	660,901
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	1,404,832	599,843	1,312,653	549,994
8	うち、負債性有価証券の額	80,254	80,254	110,906	110,906
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		55,177		70,738
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	1,548,004	222,775	1,595,046	255,161
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	99,639	99,639	130,679	130,679
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	1,448,364	123,135	1,464,367	124,482
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	30,505	28,965	48,884	41,429
15	偶発事象に係る資金流出額	40,309	9,766	40,997	9,082
16	資金流出合計額		1,385,283		1,424,859
<b>資金流入額 (3)</b>					
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	305,902	167,398	335,453	219,976
19	その他資金流入額	213,359	111,786	231,792	132,621
20	資金流入合計額	519,261	279,185	567,245	352,598
<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		1,595,136		1,342,554
22	純資金流出額		1,106,097		1,072,261
23	連結流動性カバレッジ比率		144.2		125.2
24	平均値計算用データ数		3		3

## 2. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項【単体】

(単位:百万円、%、件)

項目		平成28年度第1四半期 (平成28年4月1日から平成28年6月30日まで)		平成28年度第2四半期 (平成28年7月1日から平成28年9月30日まで)	
		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
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	1,595,136		1,342,554	
<b>資金流出額 (2)</b>					
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	4,775,340	388,500	4,776,756	387,546
3	うち、安定預金の額	1,441,991	43,259	1,458,438	43,753
4	うち、準安定預金の額	3,333,348	345,240	3,318,317	343,793
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,493,492	688,504	1,432,171	669,512
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	1,411,421	606,432	1,319,147	556,488
8	うち、負債性有価証券の額	82,071	82,071	113,023	113,023
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	—	55,177	—	70,738
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	1,554,608	224,938	1,601,646	257,321
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	99,643	99,643	130,679	130,679
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	1,454,964	125,295	1,470,967	126,642
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	6,775	5,234	25,956	18,501
15	偶発事象に係る資金流出額	40,309	9,766	40,997	9,082
16	資金流出合計額	—	1,372,121	—	1,412,703
<b>資金流入額 (3)</b>					
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	306,150	167,522	336,046	220,273
19	その他資金流入額	213,363	111,791	231,793	132,622
20	資金流入合計額	519,514	279,313	567,839	352,895
<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	—	1,595,136	—	1,342,554
22	純資金流出額	—	1,092,808	—	1,059,807
23	単体流動性カバレッジ比率	—	145.9	—	126.6
24	平均値計算用データ数	3		3	