

Ⅲ. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項【連結・単体共通】

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27年度第3四半期 (平成27年10月1日から平成27年12月31日まで)		平成27年度第4四半期 (平成28年1月1日から平成28年3月31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		1,559,522		1,534,532
<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	4,747,989	386,272	4,764,565	388,200
3	うち、安定預金の額	1,429,832	42,894	1,427,367	42,821
4	うち、準安定預金の額	3,318,156	343,377	3,337,197	345,379
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,382,989	677,107	1,418,234	677,022
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	1,290,949	585,068	1,347,458	606,245
8	うち、負債性有価証券の額	92,039	92,039	70,776	70,776
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		50,843		58,703
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	1,527,287	240,016	1,500,963	207,735
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	120,715	120,715	87,984	87,984
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	1,406,571	119,300	1,412,979	119,751
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	43,781	34,762	55,465	34,856
15	偶発事象に係る資金流出額	41,208	10,280	42,083	9,640
16	資金流出合計額		1,399,283		1,376,159
<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	328,790	183,000	302,611	168,732
19	その他資金流入額	192,935	136,726	211,218	126,360
20	資金流入合計額	521,725	319,726	513,830	295,092
<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		1,559,522		1,534,532
22	純資金流出額		1,079,556		1,081,066
23	連結流動性カバレッジ比率		144.4		141.9
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27年度第3四半期 (平成27年10月1日から平成27年12月31日まで)		平成27年度第4四半期 (平成28年1月1日から平成28年3月31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	1,559,522		1,534,532	
<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	4,747,989	386,272	4,764,565	388,200
3	うち、安定預金の額	1,429,832	42,894	1,427,367	42,821
4	うち、準安定預金の額	3,318,156	343,377	3,337,197	345,379
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,391,752	685,870	1,426,942	685,730
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	1,299,379	593,497	1,354,766	613,553
8	うち、負債性有価証券の額	92,373	92,373	72,176	72,176
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	—	50,843	—	58,703
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	1,533,887	242,176	1,507,583	209,915
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	120,715	120,715	88,004	88,004
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	1,413,171	121,460	1,419,579	121,911
14	資金提供義務等に基づく資金流出額等	18,130	9,111	29,813	9,204
15	偶発事象に係る資金流出額	41,208	10,280	42,083	9,640
16	資金流出合計額	—	1,384,554	—	1,361,394
<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	329,192	183,201	303,330	169,092
19	その他資金流入額	192,937	136,729	211,240	126,382
20	資金流入合計額	522,130	319,930	514,571	295,474
<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	—	1,559,522	—	1,534,532
22	純資金流出額	—	1,064,624	—	1,065,919
23	単体流動性カバレッジ比率	—	146.4	—	143.9
24	平均値計算用データ数	3		3	