

〈流動性カバレッジ比率に関する開示事項〉(平成29年3月期 第1四半期)

1. 連結流動性カバレッジ比率

(単位:百万円、%、件)

項 目		当四半期	
適格流動資産 (1)			
1	適格流動資産の合計額	777,151	
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
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	2,415,871	191,976
3	うち、安定預金の額	718,677	21,560
4	うち、準安定預金の額	1,697,194	170,416
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	671,718	299,621
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	644,936	272,838
8	うち、負債性有価証券の額	26,782	26,782
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		8,838
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	43,579	28,605
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	26,574	26,574
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	17,004	2,030
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	25,853	10,815
15	偶発事象に係る資金流出額	521,163	15,418
16	資金流出合計額		555,276
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
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	47,584	36,697
19	その他資金流入額	131,596	81,825
20	資金流入合計額		118,522
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		777,151
22	純資金流出額		436,753
23	連結流動性カバレッジ比率		178.4
24	平均値計算用データ数	3	

上記は、平成27年金融庁告示第7号の別紙様式第2号に基づく開示事項です。

## 2. 単体流動性カバレッジ比率

(単位:百万円、%、件)

項 目		当四半期	
適格流動資産 (1)			
1	適格流動資産の合計額	777,151	
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
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	2,415,871	191,976
3	うち、安定預金の額	718,677	21,560
4	うち、準安定預金の額	1,697,194	170,416
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	673,200	301,103
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	646,417	274,320
8	うち、負債性有価証券の額	26,782	26,782
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		8,838
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	43,579	28,605
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	26,574	26,574
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	17,004	2,030
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	25,853	9,552
15	偶発事象に係る資金流出額	498,114	14,750
16	資金流出合計額		554,826
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
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	43,673	34,480
19	その他資金流入額	131,529	81,796
20	資金流入合計額		116,276
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		777,151
22	純資金流出額		438,549
23	単体流動性カバレッジ比率		177.6
24	平均値計算用データ数	3	