

単体流動性カバレッジ比率に関する事項

（平成27年金融庁告示第7号、別紙様式第一号）

（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 | 1,029,681 | | 1,120,134 | |
| 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 | 3,398,250 | 277,550 | 3,455,133 | 283,038 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 890,185 | 26,705 | 893,047 | 26,791 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 2,508,064 | 250,844 | 2,562,086 | 256,246 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 1,224,075 | 652,858 | 1,244,956 | 669,167 |
| 6 | うち、適格オペレーショナル預金の額 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 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 | 1,040,002 | 468,786 | 1,020,908 | 445,119 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 184,072 | 184,072 | 224,047 | 224,047 |
| 9 | 有担保資金調達等に係る資金流出額 | | 1,829 | | 1,897 |
| 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 | 319,251 | 45,891 | 311,641 | 45,392 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 15,097 | 15,097 | 15,186 | 15,186 |
| 12 | うち、資金調達プログラムに係る資金流出額 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 13 | うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額 | 304,154 | 30,794 | 296,454 | 30,205 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 34,372 | 25,847 | 34,459 | 27,555 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 224,444 | 6,497 | 224,162 | 6,504 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 1,010,475 | | 1,033,556 |
| 資金流入額 (3) | | 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 |
| 17 | 有担保資金運用等に係る資金流入額 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 18 | 貸付金等の回収に係る資金流入額 | 382,057 | 288,497 | 382,839 | 286,873 |
| 19 | その他資金流入額 | 29,040 | 7,478 | 43,398 | 20,764 |
| 20 | 資金流入合計額 | 411,097 | 295,975 | 426,238 | 307,638 |
| 単体流動性カバレッジ比率 | | | | | |
| 21 | 算入可能適格流動資産の合計額 | | 1,029,681 | | 1,120,134 |
| 22 | 純資金流出額 | | 714,499 | | 725,917 |
| 23 | 単体流動性カバレッジ比率 | | 144.1 | | 154.3 |
| 24 | 平均値計算用データ数 | | 62 | | 62 |