

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         |              |
|---------------------|---|--------------|--------------|--------------|--------------|
| <b>適格流動資産 (1)</b>   |   |              |              |              |              |
| 1                   | 適格流動資産の合計額                                      | 1,403,364    |              | 1,531,973    |              |
| <b>資金流出額 (2)</b>    |   | 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                             | 3,360,376    | 277,928      | 3,355,508    | 277,958      |
| 3                   | うち、安定預金の額                                       | 830,679      | 24,920       | 823,316      | 24,699       |
| 4                   | うち、準安定預金の額                                      | 2,529,697    | 253,008      | 2,532,191    | 253,258      |
| 5                   | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額                           | 1,159,476    | 566,467      | 1,232,357    | 626,981      |
| 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 | 985,307      | 392,298      | 1,021,687    | 416,312      |
| 8                   | うち、負債性有価証券の額                                    | 174,168      | 174,168      | 210,669      | 210,669      |
| 9                   | 有担保資金調達等に係る資金流出額                                |              |              | 0            |              |
| 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       | 263,630      | 31,719       | 264,677      | 30,828       |
| 11                  | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額                            | 13,342       | 13,342       | 11,281       | 11,281       |
| 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                         | 250,287      | 18,376       | 253,396      | 19,547       |
| 14                  | 資金提供義務に基づく資金流出額等                                | 67,010       | 60,674       | 53,521       | 49,964       |
| 15                  | 偶発事象に係る資金流出額                                    | 228,154      | 6,637        | 222,374      | 6,382        |
| 16                  | 資金流出合計額   | 943,427      |              | 992,115      |              |
| <b>資金流入額 (3)</b>    |   | 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                                 | 495,365      | 396,783      | 427,398      | 341,325      |
| 19                  | その他資金流入額  | 78,305       | 43,412       | 67,222       | 44,717       |
| 20                  | 資金流入合計額   | 573,671      | 440,196      | 494,620      | 386,042      |
| <b>単体流動性カバレッジ比率</b> |   |              |              |              |              |
| 21                  | 算入可能適格流動資産の合計額                                  | 1,403,364    |              | 1,531,973    |              |
| 22                  | 純資金流出額  | 503,230      |              | 606,072      |              |
| 23                  | 単体流動性カバレッジ比率                                    | 278.8        |              | 252.7        |              |
| 24                  | 平均値計算用データ数                                      | 3            |              | 3            |              |