

連結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、別紙様式第三号)

(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 | 2,450,608 | | 2,452,075 | |
| 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 | 6,775,145 | 546,997 | 6,760,013 | 546,165 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 1,865,093 | 55,952 | 1,855,398 | 55,661 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 4,910,052 | 491,044 | 4,904,614 | 490,503 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 2,908,648 | 1,398,441 | 2,969,670 | 1,461,531 |
| 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 | 2,713,340 | 1,203,133 | 2,751,715 | 1,243,576 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 195,307 | 195,307 | 217,954 | 217,954 |
| 9 | 有担保資金調達等に係る資金流出額 | | 1,532 | | 665 |
| 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 | 553,354 | 78,518 | 559,723 | 78,635 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 39,092 | 39,092 | 38,965 | 38,965 |
| 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 | 514,261 | 39,426 | 520,758 | 39,670 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 57,224 | 53,140 | 53,620 | 47,120 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 374,743 | 10,228 | 379,496 | 10,337 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 2,088,858 | | 2,144,456 |
| 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 | 420,065 | 235,922 | 388,469 | 225,715 |
| 19 | その他資金流入額 | 56,429 | 51,751 | 48,830 | 35,598 |
| 20 | 資金流入合計額 | 476,495 | 287,674 | 437,299 | 261,313 |
| 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 | | 2,450,608 | | 2,452,075 |
| 22 | 純資金流出額 | | 1,801,183 | | 1,883,142 |
| 23 | 連結流動性カバレッジ比率 | | 136.0 | | 130.2 |
| 24 | 平均値計算用データ数 | | 58 | | 62 |