

Ⅲ. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

1. 連結流動性カバレッジ比率

(単位：百万円、%、件)

項 目		平成28年3月期		平成27年12月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	994,663		1,018,289	
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	4,452,359	375,908	4,439,055	375,093
3	うち、安定預金の額	1,000,230	30,006	993,292	29,798
4	うち、準安定預金の額	3,452,129	345,901	3,445,763	345,295
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,369,393	529,856	1,363,898	551,365
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	1,340,217	500,681	1,291,751	479,218
8	うち、負債性有価証券の額	29,175	29,175	72,147	72,147
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	—		—	
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	81,103	16,637	81,148	16,168
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	7,987	7,987	7,758	7,758
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	73,116	8,650	73,390	8,410
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	21,110	20,814	27,740	27,273
15	偶発事象に係る資金流出額	1,210,401	23,511	1,191,438	23,494
16	資金流出合計額	966,729		993,396	
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	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	270,985	150,757	297,460	165,964
19	その他資金流入額	16,168	9,372	29,950	20,704
20	資金流入合計額	287,153	160,129	327,410	186,668
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	994,663		1,018,289	
22	純資金流出額	806,600		806,728	
23	連結流動性カバレッジ比率	123.3%		126.2%	
24	平均値計算用データ数	3		3	

2. 単体流動性カバレッジ比率

(単位：百万円、%、件)

項 目		平成28年3月期		平成27年12月期	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	994,663		1,018,289	
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	4,452,359	375,908	4,439,055	375,093
3	うち、安定預金の額	1,000,230	30,006	993,292	29,798
4	うち、準安定預金の額	3,452,129	345,901	3,445,763	345,295
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,375,819	536,282	1,369,335	556,803
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	1,346,410	506,873	1,296,255	483,722
8	うち、負債性有価証券の額	29,408	29,408	73,080	73,080
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	—		—	
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	81,103	16,637	81,148	16,168
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	7,987	7,987	7,758	7,758
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	73,116	8,650	73,390	8,410
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	647	351	6,738	6,272
15	偶発事象に係る資金流出額	1,214,027	23,511	1,194,628	23,494
16	資金流出合計額	952,692		977,832	
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	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	279,272	159,045	309,435	177,939
19	その他資金流入額	16,187	9,391	29,979	20,733
20	資金流入合計額	295,459	168,436	339,414	198,672
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	994,663		1,018,289	
22	純資金流出額	784,256		779,160	
23	単体流動性カバレッジ比率	126.8%		130.6%	
24	平均値計算用データ数	3		3	