

# 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29年3月期		平成28年12月期	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	1,097,629		1,084,845	
<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	4,564,970	389,219	4,532,957	382,240
3	うち、安定預金の額	970,250	29,107	1,024,452	30,733
4	うち、準安定預金の額	3,594,719	360,111	3,508,504	351,506
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,494,594	641,917	1,382,727	536,066
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	1,408,746	556,068	1,319,991	473,330
8	うち、負債性有価証券の額	85,848	85,848	62,735	62,735
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	14,626		12,102	
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	89,914	21,080	87,978	22,744
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	14,018	11,347	13,501	13,501
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	75,896	9,733	74,477	9,243
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	40,892	27,219	31,141	29,146
15	偶発事象に係る資金流出額	1,235,061	24,436	1,216,719	23,429
16	資金流出合計額	1,118,500		1,005,730	
<b>資金流入額 (3)</b>		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	303,901	164,761	269,098	158,573
19	その他資金流入額	77,840	14,998	39,110	22,148
20	資金流入合計額	381,741	179,759	308,208	180,721
<b>連結流動性カバレッジ比率 (4)</b>					
21	算入可能適格流動資産の合計額	1,097,629		1,084,845	
22	純資金流出額	938,740		825,008	
23	連結流動性カバレッジ比率	116.9%		131.4%	
24	平均値計算用データ数	61		3	

## 2. 単体流動性カバレッジ比率

(単位：百万円、%、件)

項 目		平成29年3月期		平成28年12月期	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	1,097,629		1,084,845	
<b>資金流出額 (2)</b>		<b>資金流出率を乗じる前の額</b>	<b>資金流出率を乗じた後の額</b>	<b>資金流出率を乗じる前の額</b>	<b>資金流出率を乗じた後の額</b>
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	4,564,970	389,219	4,532,957	382,240
3	うち、安定預金の額	970,250	29,107	1,024,452	30,733
4	うち、準安定預金の額	3,594,719	360,111	3,508,504	351,506
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,503,050	650,372	1,390,568	543,907
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	1,415,442	562,765	1,325,966	479,305
8	うち、負債性有価証券の額	87,607	87,607	64,602	64,602
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	14,626		12,102	
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	89,914	21,080	87,978	22,744
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	14,018	11,347	13,501	13,501
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	75,896	9,733	74,477	9,243
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	18,959	5,286	9,512	7,518
15	偶発事象に係る資金流出額	1,238,750	24,436	1,220,106	23,429
16	資金流出合計額	1,105,022		991,943	
<b>資金流入額 (3)</b>		<b>資金流入率を乗じる前の額</b>	<b>資金流入率を乗じた後の額</b>	<b>資金流入率を乗じる前の額</b>	<b>資金流入率を乗じた後の額</b>
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	314,721	175,581	279,345	168,820
19	その他資金流入額	77,864	15,021	39,137	22,174
20	資金流入合計額	392,585	190,603	318,482	190,995
<b>単体流動性カバレッジ比率 (4)</b>					
21	算入可能適格流動資産の合計額	1,097,629		1,084,845	
22	純資金流出額	914,419		800,948	
23	単体流動性カバレッジ比率	120.0%		135.4%	
24	平均値計算用データ数	61		3	