

連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

(別紙様式第二号)

(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	1,090,339		1,083,867	
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	4,750,612	402,611	4,702,120	400,176
3 うち、安定預金の額	1,043,383	31,301	1,008,892	30,266
4 うち、準安定預金の額	3,707,228	371,309	3,693,228	369,910
5 ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,515,941	579,835	1,580,634	618,990
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	1,454,371	518,265	1,513,226	551,582
8 うち、負債性有価証券の額	61,570	61,570	67,408	67,408
9 有担保資金調達等に係る資金流出額		1,604		7,354
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	108,072	23,992	107,929	24,979
11 うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	10,297	10,297	12,069	12,069
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	97,775	13,695	95,860	12,910
14 資金提供義務に基づく資金流出額等	28,478	26,985	21,441	20,549
15 偶発事象に係る資金流出額	1,241,539	28,202	1,238,901	26,366
16 資金流出合計額		1,063,232		1,098,418
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	328,586	194,505	318,719	190,646
19 その他資金流入額	27,674	10,396	40,520	21,558
20 資金流入合計額	356,260	204,901	359,239	212,204
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		1,090,339		1,083,867
22 純資金流出額		858,330		886,214
23 連結流動性カバレッジ比率		127.0%		122.3%
24 平均値計算用データ数		62		62