

単体流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

(別紙様式第一号)

(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 | 826,821 | | - | |
| 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 | 4,419,365 | 374,079 | - | - |
| 3 | うち、安定預金の額 | 980,780 | 29,423 | - | - |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 3,438,585 | 344,655 | - | - |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 1,398,483 | 566,842 | - | - |
| 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 | 1,331,208 | 499,568 | - | - |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 67,274 | 67,274 | - | - |
| 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 | 124,785 | 48,510 | - | - |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 38,849 | 38,849 | - | - |
| 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 | 85,936 | 9,661 | - | - |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 4,741 | 2,216 | - | - |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 1,171,472 | 22,784 | - | - |
| 16 | 資金流出合計額 | | 1,014,433 | | - |
| 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 | 304,205 | 187,159 | - | - |
| 19 | その他資金流入額 | 59,234 | 46,072 | - | - |
| 20 | 資金流入合計額 | 363,439 | 233,231 | - | - |
| 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 | | 826,821 | | - |
| 22 | 純資金流出額 | | 781,201 | | - |
| 23 | 単体流動性カバレッジ比率 | | 105.8% | | - |
| 24 | 平均値計算用データ数 | | 3 | | - |