

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 | 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 |