

## 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         |              |
|---|--------------|--------------|--------------|--------------|
| <b>適格流動資産 (1)</b>                                 |              |              |              |              |
| 1 適格流動資産の合計額                                      | 994,663      |              | 1,018,289    |              |
| <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                             | 4,452,359    | 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      |
| <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                                | 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      |
| <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                                 |              | 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            |