

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	1,073,844		994,663	
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	4,473,881	376,919	4,452,359	375,908
3	うち、安定預金の額	1,015,893	30,476	1,000,230	30,006
4	うち、準安定預金の額	3,457,988	346,442	3,452,129	345,901
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,387,936	535,039	1,369,393	529,856
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	1,327,385	474,488	1,340,217	500,681
8	うち、負債性有価証券の額	60,550	60,550	29,175	29,175
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	86,146	21,648	81,103	16,637
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	12,769	12,769	7,987	7,987
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	73,377	8,879	73,116	8,650
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	24,115	23,530	21,110	20,814
15	偶発事象に係る資金流出額	1,210,898	22,782	1,210,401	23,511
16	資金流出合計額		979,920		966,729
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	250,568	136,628	270,985	150,757
19	その他資金流入額	25,359	18,723	16,168	9,372
20	資金流入合計額	275,927	155,351	287,153	160,129
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		1,073,844		994,663
22	純資金流出額		824,568		806,600
23	連結流動性カバレッジ比率		130.2%		123.3%
24	平均値計算用データ数		3		3