

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 | 1,066,138 | | 1,073,844 | |
| 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 | 4,505,596 | 380,150 | 4,473,881 | 376,919 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 1,014,821 | 30,444 | 1,015,893 | 30,476 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 3,490,775 | 349,705 | 3,457,988 | 346,442 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 1,360,337 | 538,886 | 1,395,569 | 542,673 |
| 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 | 1,294,724 | 473,273 | 1,334,485 | 481,589 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 65,613 | 65,613 | 61,084 | 61,084 |
| 9 | 有担保資金調達等に係る資金流出額 | | 2,384 | | - |
| 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 | 92,242 | 27,084 | 86,146 | 21,648 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 18,040 | 18,040 | 12,769 | 12,769 |
| 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 | 74,202 | 9,044 | 73,377 | 8,879 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 1,985 | 1,102 | 2,446 | 1,862 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 1,227,070 | 23,171 | 1,214,731 | 22,782 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 972,780 | | 965,886 |
| 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 | 248,273 | 140,186 | 259,682 | 145,742 |
| 19 | その他資金流入額 | 31,334 | 12,360 | 25,379 | 18,743 |
| 20 | 資金流入合計額 | 279,607 | 152,546 | 285,061 | 164,485 |
| 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 | | 1,066,138 | | 1,073,844 |
| 22 | 純資金流出額 | | 820,233 | | 801,400 |
| 23 | 単体流動性カバレッジ比率 | | 129.9% | | 133.9% |
| 24 | 平均値計算用データ数 | | 3 | | 3 |