

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	1,145,704		1,097,629	
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	4,581,694	391,016	4,564,970	389,219
3	うち、安定預金の額	968,275	29,048	970,250	29,107
4	うち、準安定預金の額	3,613,418	361,968	3,594,719	360,111
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,532,073	618,104	1,503,050	650,372
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	1,461,233	547,263	1,415,442	562,765
8	うち、負債性有価証券の額	70,840	70,840	87,607	87,607
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		8,835		14,626
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	103,514	23,628	89,914	21,080
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	12,342	12,342	14,018	11,347
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	91,172	11,286	75,896	9,733
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	3,199	2,488	18,959	5,286
15	偶発事象に係る資金流出額	1,253,655	26,302	1,238,750	24,436
16	資金流出合計額		1,070,374		1,105,022
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	285,228	160,985	314,721	175,581
19	その他資金流入額	61,196	23,812	77,864	15,021
20	資金流入合計額	346,424	184,798	392,585	190,603
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		1,145,704		1,097,629
22	純資金流出額		885,576		914,419
23	単体流動性カバレッジ比率		129.3%		120.0%
24	平均値計算用データ数		62		61