

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 | 1,083,867 | | 1,101,210 | |
| 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 | 4,702,120 | 400,176 | 4,692,116 | 399,001 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 1,008,892 | 30,266 | 1,011,411 | 30,342 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 3,693,228 | 369,910 | 3,680,704 | 368,659 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 1,580,634 | 618,990 | 1,536,486 | 631,340 |
| 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 | 1,513,226 | 551,582 | 1,439,876 | 534,730 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 67,408 | 67,408 | 96,610 | 96,610 |
| 9 | 有担保資金調達等に係る資金流出額 | | 7,354 | | 12,230 |
| 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 | 107,929 | 24,979 | 100,376 | 28,116 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 12,069 | 12,069 | 17,261 | 17,261 |
| 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 | 95,860 | 12,910 | 83,115 | 10,855 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 21,441 | 20,549 | 34,980 | 27,106 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 1,238,901 | 26,366 | 1,241,504 | 27,534 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 1,098,418 | | 1,125,331 |
| 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 | 318,719 | 190,646 | 309,552 | 171,605 |
| 19 | その他資金流入額 | 40,520 | 21,558 | 49,127 | 16,032 |
| 20 | 資金流入合計額 | 359,239 | 212,204 | 358,679 | 187,638 |
| 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 | | 1,083,867 | | 1,101,210 |
| 22 | 純資金流出額 | | 886,214 | | 937,692 |
| 23 | 連結流動性カバレッジ比率 | | 122.3% | | 117.4% |
| 24 | 平均値計算用データ数 | | 62 | | 59 |