

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	1,086,746		1,090,339	
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	4,750,796	402,885	4,750,612	402,611
3 うち、安定預金の額	1,039,609	31,188	1,043,383	31,301
4 うち、準安定預金の額	3,711,186	371,697	3,707,228	371,309
5 ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,502,568	572,930	1,515,941	579,835
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	1,431,017	501,378	1,454,371	518,265
8 うち、負債性有価証券の額	71,551	71,551	61,570	61,570
9 有担保資金調達等に係る資金流出額		9,845		1,604
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	109,659	27,850	108,072	23,992
11 うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	14,467	14,467	10,297	10,297
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	95,192	13,383	97,775	13,695
14 資金提供義務に基づく資金流出額等	29,626	26,891	28,478	26,985
15 偶発事象に係る資金流出額	1,236,300	29,080	1,241,539	28,202
16 資金流出合計額		1,069,484		1,063,232
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	289,920	168,127	328,586	194,505
19 その他資金流入額	44,364	31,701	27,674	10,396
20 資金流入合計額	334,284	199,829	356,260	204,901
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		1,086,746		1,090,339
22 純資金流出額		869,654		858,330
23 連結流動性カバレッジ比率		124.9%		127.0%
24 平均値計算用データ数		62		62