

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	1,001,874		826,821	
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	4,428,738	374,798	4,419,365	374,079
3	うち、安定預金の額	983,152	29,494	980,780	29,423
4	うち、準安定預金の額	3,445,585	345,303	3,438,585	344,655
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,354,413	552,248	1,398,483	566,842
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	1,284,724	482,559	1,331,208	499,568
8	うち、負債性有価証券の額	69,688	69,688	67,274	67,274
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	88,518	20,369	124,785	48,510
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	11,605	11,605	38,849	38,849
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	76,913	8,764	85,936	9,661
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	527	231	4,741	2,216
15	偶発事象に係る資金流出額	1,200,241	23,674	1,171,472	22,784
16	資金流出合計額		971,322		1,014,433
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	295,372	170,505	304,205	187,159
19	その他資金流入額	36,217	14,707	59,234	46,072
20	資金流入合計額	331,589	185,212	363,439	233,231
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		1,001,874		826,821
22	純資金流出額		786,109		781,201
23	単体流動性カバレッジ比率		127.4%		105.8%
24	平均値計算用データ数		3		3