

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	1,018,289		1,001,874	
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	4,439,055	375,093	4,428,738	374,798
3 うち、安定預金の額	993,292	29,798	983,152	29,494
4 うち、準安定預金の額	3,445,763	345,295	3,445,585	345,303
5 ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,363,898	551,365	1,350,281	548,116
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	1,291,751	479,218	1,280,759	478,594
8 うち、負債性有価証券の額	72,147	72,147	69,522	69,522
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	81,148	16,168	88,518	20,369
11 うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	7,758	7,758	11,605	11,605
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	73,390	8,410	76,913	8,764
14 資金提供義務に基づく資金流出額等	27,740	27,273	20,737	20,442
15 偶発事象に係る資金流出額	1,191,438	23,494	1,196,907	23,674
16 資金流出合計額		993,396		987,401
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	297,460	165,964	285,970	161,103
19 その他資金流入額	29,950	20,704	36,204	14,693
20 資金流入合計額	327,410	186,668	322,174	175,796
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		1,018,289		1,001,874
22 純資金流出額		806,728		811,604
23 連結流動性カバレッジ比率		126.2%		123.4%
24 平均値計算用データ数		3		3