

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	1,066,138		1,073,844	
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	4,505,596	380,150	4,473,881	376,919
3	うち、安定預金の額	1,014,821	30,444	1,015,893	30,476
4	うち、準安定預金の額	3,490,775	349,705	3,457,988	346,442
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,352,196	530,745	1,387,936	535,039
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	1,287,982	466,532	1,327,385	474,488
8	うち、負債性有価証券の額	64,213	64,213	60,550	60,550
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		2,384		-
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	92,242	27,084	86,146	21,648
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	18,040	18,040	12,769	12,769
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	74,202	9,044	73,377	8,879
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	22,625	21,743	24,115	23,530
15	偶発事象に係る資金流出額	1,223,567	23,171	1,210,898	22,782
16	資金流出合計額		985,279		979,920
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	242,468	134,381	250,568	136,628
19	その他資金流入額	31,320	12,346	25,359	18,723
20	資金流入合計額	273,788	146,728	275,927	155,351
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		1,066,138		1,073,844
22	純資金流出額		838,551		824,568
23	連結流動性カバレッジ比率		127.1%		130.2%
24	平均値計算用データ数		3		3