

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	1,084,845		1,066,138	
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	4,532,957	382,240	4,505,596	380,150
3	うち、安定預金の額	1,024,452	30,733	1,014,821	30,444
4	うち、準安定預金の額	3,508,504	351,506	3,490,775	349,705
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,390,568	543,907	1,360,337	538,886
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	1,325,966	479,305	1,294,724	473,273
8	うち、負債性有価証券の額	64,602	64,602	65,613	65,613
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		12,102		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	87,978	22,744	92,242	27,084
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	13,501	13,501	18,040	18,040
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	74,477	9,243	74,202	9,044
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	9,512	7,518	1,985	1,102
15	偶発事象に係る資金流出額	1,220,106	23,429	1,227,070	23,171
16	資金流出合計額		991,943		972,780
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	279,345	168,820	248,273	140,186
19	その他資金流入額	39,137	22,174	31,334	12,360
20	資金流入合計額	318,482	190,995	279,607	152,546
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		1,084,845		1,066,138
22	純資金流出額		800,948		820,233
23	単体流動性カバレッジ比率		135.4%		129.9%
24	平均値計算用データ数		3		3