

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	1,097,629		1,084,845	
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	4,564,970	389,219	4,532,957	382,240
3 うち、安定預金の額	970,250	29,107	1,024,452	30,733
4 うち、準安定預金の額	3,594,719	360,111	3,508,504	351,506
5 ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,494,594	641,917	1,382,727	536,066
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	1,408,746	556,068	1,319,991	473,330
8 うち、負債性有価証券の額	85,848	85,848	62,735	62,735
9 有担保資金調達等に係る資金流出額		14,626		12,102
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	89,914	21,080	87,978	22,744
11 うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	14,018	11,347	13,501	13,501
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	75,896	9,733	74,477	9,243
14 資金提供義務に基づく資金流出額等	40,892	27,219	31,141	29,146
15 偶発事象に係る資金流出額	1,235,061	24,436	1,216,719	23,429
16 資金流出合計額		1,118,500		1,005,730
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	303,901	164,761	269,098	158,573
19 その他資金流入額	77,840	14,998	39,110	22,148
20 資金流入合計額	381,741	179,759	308,208	180,721
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		1,097,629		1,084,845
22 純資金流出額		938,740		825,008
23 連結流動性カバレッジ比率		116.9%		131.4%
24 平均値計算用データ数		61		3