

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 | 1,097,629 | | 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 | 1,503,050 | 650,372 | 1,390,568 | 543,907 |
| 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 | 1,415,442 | 562,765 | 1,325,966 | 479,305 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 87,607 | 87,607 | 64,602 | 64,602 |
| 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 | 18,959 | 5,286 | 9,512 | 7,518 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 1,238,750 | 24,436 | 1,220,106 | 23,429 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 1,105,022 | | 991,943 |
| 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 | 314,721 | 175,581 | 279,345 | 168,820 |
| 19 | その他資金流入額 | 77,864 | 15,021 | 39,137 | 22,174 |
| 20 | 資金流入合計額 | 392,585 | 190,603 | 318,482 | 190,995 |
| 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 | | 1,097,629 | | 1,084,845 |
| 22 | 純資金流出額 | | 914,419 | | 800,948 |
| 23 | 単体流動性カバレッジ比率 | | 120.0% | | 135.4% |
| 24 | 平均値計算用データ数 | | 61 | | 3 |