

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	1,141,935	1,145,704
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
2 リテール無担保資金調達に係る資金流出額	4,640,193	394,993
3 うち、安定預金の額	994,867	29,846
4 うち、準安定預金の額	3,645,326	365,147
5 ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,492,883	607,441
6 うち、適格オペレーション預金の額	-	-
7 うち、適格オペレーション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	1,416,898	531,456
8 うち、負債性有価証券の額	75,984	75,984
9 有担保資金調達等に係る資金流出額		4,038
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	101,709	24,903
11 うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	13,924	13,924
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	87,785	10,979
14 資金提供義務に基づく資金流出額等	26,656	25,370
15 偶発事象に係る資金流出額	1,249,478	27,369
16 資金流出合計額		1,084,116
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
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	284,376	153,826
19 その他資金流入額	59,913	16,753
20 資金流入合計額	344,289	170,580
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		1,141,935
22 純資金流出額		913,536
23 連結流動性カバレッジ比率		125.0%
24 平均値計算用データ数		62