

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	1,113,303		1,141,935	
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	4,657,324	396,384	4,640,193	394,993
3	うち、安定預金の額	999,415	29,982	994,867	29,846
4	うち、準安定預金の額	3,657,909	366,402	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	1,487,569	589,759	1,492,883	607,441
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	1,407,403	509,593	1,416,898	531,456
8	うち、負債性有価証券の額	80,166	80,166	75,984	75,984
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		4,315		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	98,985	24,260	101,709	24,903
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	13,466	13,466	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	85,519	10,794	87,785	10,979
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	28,574	27,089	26,656	25,370
15	偶発事象に係る資金流出額	1,247,220	27,179	1,249,478	27,369
16	資金流出合計額		1,068,989		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	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	312,512	172,275	284,376	153,826
19	その他資金流入額	56,671	26,629	59,913	16,753
20	資金流入合計額	369,183	198,904	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		1,113,303		1,141,935
22	純資金流出額		870,084		913,536
23	連結流動性カバレッジ比率		127.9%		125.0%
24	平均値計算用データ数		62		62