

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	1,113,303		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	1,495,219	597,409	1,500,983	615,541
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	1,413,192	515,382	1,423,113	537,671
8	うち、負債性有価証券の額	82,027	82,027	77,870	77,870
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	6,754	5,269	3,925	2,639
15	偶発事象に係る資金流出額	1,251,747	27,179	1,254,194	27,369
16	資金流出合計額		1,054,819		1,069,485
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	323,504	183,267	294,960	164,410
19	その他資金流入額	56,696	26,654	59,937	16,776
20	資金流入合計額	380,200	209,921	354,897	181,187
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		1,113,303		1,141,935
22	純資金流出額		844,898		888,298
23	単体流動性カバレッジ比率		131.7%		128.5%
24	平均値計算用データ数		62		62