

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	1,101,210		1,113,303	
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	4,692,116	399,001	4,657,324	396,384
3 うち、安定預金の額	1,011,411	30,342	999,415	29,982
4 うち、準安定預金の額	3,680,704	368,659	3,657,909	366,402
5 ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,536,486	631,340	1,487,569	589,759
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	1,439,876	534,730	1,407,403	509,593
8 うち、負債性有価証券の額	96,610	96,610	80,166	80,166
9 有担保資金調達等に係る資金流出額		12,230		4,315
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	100,376	28,116	98,985	24,260
11 うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	17,261	17,261	13,466	13,466
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	83,115	10,855	85,519	10,794
14 資金提供義務に基づく資金流出額等	34,980	27,106	28,574	27,089
15 偶発事象に係る資金流出額	1,241,504	27,534	1,247,220	27,179
16 資金流出合計額		1,125,331		1,068,989
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	309,552	171,605	312,512	172,275
19 その他資金流入額	49,127	16,032	56,671	26,629
20 資金流入合計額	358,679	187,638	369,183	198,904
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		1,101,210		1,113,303
22 純資金流出額		937,692		870,084
23 連結流動性カバレッジ比率		117.4%		127.9%
24 平均値計算用データ数		59		62