

単体流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（27年12月期）

（27年2月27日金融庁告示7号 別紙様式第一号）

（単位：百万円、%、件）

項目		当四半期		前四半期	
<b>適格流動資産（1）</b>					
1	適格流動資産の合計額	1,583,995		1,547,929	
<b>資金流出額（2）</b>		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	4,602,536	359,457	4,582,639	358,675
3	うち、安定預金の額	1,510,936	45,328	1,496,087	44,882
4	うち、準安定預金の額	3,091,285	314,129	3,085,968	313,792
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,263,019	570,038	1,178,802	526,512
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	1,074,078	381,097	1,013,298	361,008
8	うち、負債性有価証券の額	188,940	188,940	165,504	165,504
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		16,296		22,661
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	1,865,915	374,473	1,841,760	355,099
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	177,009	177,009	158,833	158,833
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	1,688,906	197,464	1,682,926	196,265
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	28,931	27,533	2,135	1,901
15	偶発事象に係る資金流出額	33,508	670	33,067	661
16	資金流出合計額		1,348,470		1,265,511
<b>資金流入額（3）</b>		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	615,336	431,156	559,469	394,793
19	その他資金流入額	232,401	220,725	220,007	205,437
20	資金流入合計額	847,737	651,882	779,477	600,230
<b>単体流動性カバレッジ比率（4）</b>					
21	算入可能適格流動資産の合計額		1,583,995		1,547,929
22	純資金流出額		696,588		665,281
23	単体流動性カバレッジ比率		227.3%		232.6%
24	平均値計算用データ数		3		3

連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項（27年12月期）

（27年2月27日金融庁告示7号 別紙様式第二号）

（単位：百万円、%、件）

項目		当四半期		前四半期	
<b>適格流動資産（1）</b>					
1	適格流動資産の合計額	1,583,995		1,547,929	
<b>資金流出額（2）</b>		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	4,602,531	359,457	4,582,635	358,675
3	うち、安定預金の額	1,510,936	45,328	1,496,087	44,882
4	うち、準安定預金の額	3,091,280	314,129	3,085,965	313,792
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	1,253,096	560,661	1,172,217	519,927
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	1,064,289	371,854	1,007,146	354,856
8	うち、負債性有価証券の額	188,806	188,806	165,070	165,070
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		16,296		22,661
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	1,840,490	364,268	1,815,506	344,598
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	176,949	176,949	158,833	158,833
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	1,663,541	187,318	1,656,673	185,764
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	58,127	56,729	34,295	34,061
15	偶発事象に係る資金流出額	33,508	670	33,067	661
16	資金流出合計額		1,358,082		1,280,584
<b>資金流入額（3）</b>		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	581,149	396,970	526,216	361,541
19	その他資金流入額	232,396	220,720	217,942	205,431
20	資金流入合計額	813,545	617,691	744,159	566,973
<b>連結流動性カバレッジ比率（4）</b>					
21	算入可能適格流動資産の合計額		1,583,995		1,547,929
22	純資金流出額		740,391		713,610
23	連結流動性カバレッジ比率		213.9%		216.9%
24	平均値計算用データ数		3		3