

連結流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

(単位:百万円、%、件)

項目		当四半期 (2022/01-03)		前四半期 (2021/10-12)	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	25,954,438		27,164,191	
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	42,013	4,167	40,578	4,025
3	うち、安定預金の額	486	14	464	13
4	うち、準安定預金の額	41,526	4,152	40,114	4,011
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	10,407,199	7,239,346	11,240,433	8,022,460
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	9,461,923	6,294,070	10,422,224	7,204,251
8	うち、負債性有価証券の額	945,276	945,276	818,208	818,208
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	274,395		215,945	
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	3,318,071	1,867,980	3,204,169	1,824,868
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,578,366	1,578,366	1,541,747	1,541,747
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	1,739,705	289,614	1,662,422	283,121
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	2,938,584	694,663	2,755,408	552,513
15	偶発事象に係る資金流出額	5,913,206	129,252	5,818,101	127,319
16	資金流出合計額	10,209,805		10,747,133	
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	397,164	-	1,204,003	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	4,879,806	3,866,913	6,345,710	5,466,564
19	その他資金流入額	3,170,825	254,777	3,009,620	234,303
20	資金流入合計額	8,447,796	4,121,690	10,559,334	5,700,867
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	25,954,438		27,164,191	
22	純資金流出額	6,088,115		5,046,265	
23	連結流動性カバレッジ比率	426.3%		538.3%	
24	平均値計算用データ数	59		63	