

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 (2022/10-12)		前四半期 (2022/07-09)	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	26,757,379		26,023,064	
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	34,200	3,388	38,118	3,779
3	うち、安定預金の額	448	13	456	13
4	うち、準安定預金の額	33,751	3,375	37,662	3,766
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	14,166,161	11,063,205	13,418,753	10,237,257
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	13,352,032	10,249,076	12,283,329	9,101,833
8	うち、負債性有価証券の額	814,128	814,128	1,135,424	1,135,424
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	63,983		218,225	
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	4,310,941	2,642,159	4,013,052	2,441,122
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	2,315,587	2,315,587	2,127,710	2,127,710
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	1,995,353	326,571	1,885,342	313,412
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	2,539,877	130,179	1,908,743	154,609
15	偶発事象に係る資金流出額	7,660,046	170,511	7,296,649	157,379
16	資金流出合計額	14,073,427		13,212,374	
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	-	-	22,001	1,561
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,421,756	1,665,365	3,018,036	1,967,355
19	その他資金流入額	3,070,479	396,026	2,980,654	371,392
20	資金流入合計額	5,492,235	2,061,391	6,020,692	2,340,309
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	26,757,379		26,023,064	
22	純資金流出額	12,012,035		10,872,065	
23	連結流動性カバレッジ比率	222.7%		239.3%	
24	平均値計算用データ数	62		62	