

単体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 (2023/10-12)		前四半期 (2023/7-9)	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	26,372,190		28,237,845	
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	10,371	1,008	11,258	1,094
3	うち、安定預金の額	411	12	442	13
4	うち、準安定預金の額	9,960	996	10,815	1,081
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	15,167,664	12,120,462	15,618,124	12,416,958
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	14,413,572	11,366,370	14,513,043	11,311,877
8	うち、負債性有価証券の額	754,092	754,092	1,105,080	1,105,080
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		119,170		248,500
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	4,480,953	2,891,695	4,596,795	2,985,018
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	2,593,726	2,593,726	2,686,275	2,686,275
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	1,887,226	297,968	1,910,520	298,743
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	3,435,529	183,121	3,356,602	161,433
15	偶発事象に係る資金流出額	4,966,855	126,728	4,921,122	130,183
16	資金流出合計額		15,442,186		15,943,188
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	213,183	-	98,882	6,431
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,016,413	1,445,031	2,079,458	1,463,378
19	その他資金流入額	3,664,065	328,704	4,448,589	516,170
20	資金流入合計額	5,893,662	1,773,736	6,626,930	1,985,980
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		26,372,190		28,237,845
22	純資金流出額		13,668,450		13,957,208
23	単体流動性カバレッジ比率		192.9%		202.3%
24	平均値計算用データ数		62		62