

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 (27/7-9)		前四半期 (27/4-6)	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	28,164,618		26,177,675	
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	63,036	6,322	63,046	6,336
3	うち、安定預金の額	184	6	165	5
4	うち、準安定預金の額	62,853	6,316	62,882	6,331
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	11,198,673	8,540,133	11,277,928	8,303,615
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	0	0	0	0
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	9,510,767	6,852,226	9,766,971	6,792,658
8	うち、負債性有価証券の額	1,687,907	1,687,907	1,510,957	1,510,957
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		435,310		310,088
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	2,486,990	1,561,473	2,951,339	2,011,593
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,334,864	1,334,864	1,795,857	1,795,857
12	うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	0	0	0	0
13	うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	1,152,126	226,609	1,155,482	215,736
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	525,793	432,133	832,836	661,916
15	偶発事象に係る資金流出額	3,634,919	120,576	3,348,555	99,231
16	資金流出合計額		11,095,946		11,392,778
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	4,032	0	27,536	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	3,310,465	2,263,454	4,129,034	2,723,743
19	その他資金流入額	1,332,076	268,175	875,411	305,138
20	資金流入合計額	4,646,573	2,531,629	5,031,982	3,028,881
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		28,164,618		26,177,675
22	純資金流出額		8,564,317		8,363,898
23	連結流動性カバレッジ比率		328.8%		313.5%
24	平均値計算用データ数		3		3

(注)「四半期」の数字は、直近3ヶ月の月末平均値。