

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 (28/7-9)		前四半期 (28/4-6)	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	37,229,355		34,371,714	
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	63,091	6,379	62,221	6,284
3	うち、安定預金の額	352	11	189	6
4	うち、準安定預金の額	62,740	6,368	62,032	6,278
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	10,602,940	7,789,717	11,419,487	8,306,612
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	9,610,278	6,797,055	10,179,146	7,066,271
8	うち、負債性有価証券の額	992,662	992,662	1,240,341	1,240,341
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		150,904		168,008
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	2,565,719	1,622,435	2,572,998	1,598,415
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,400,995	1,400,995	1,367,314	1,367,314
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	1,164,725	221,440	1,205,684	231,101
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	2,748,108	265,209	1,623,429	272,210
15	偶発事象に係る資金流出額	3,184,076	106,129	3,046,642	102,513
16	資金流出合計額		9,940,774		10,454,042
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	1,069,124	0	711,350	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,066,980	1,394,338	3,210,427	2,021,740
19	その他資金流入額	2,663,578	383,949	2,716,291	406,551
20	資金流入合計額	5,799,682	1,778,287	6,638,068	2,428,291
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		37,229,355		34,371,714
22	純資金流出額		8,162,487		8,025,751
23	単体流動性カバレッジ比率		456.1%		428.2%
24	平均値計算用データ数		3		3