

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 (29/10-12) | | 前四半期 (29/7-9) | |
|-------------------------|---|--------------------|------------------|------------------|------------------|
| 適格流動資産 (1) | | | | | |
| 1 | 適格流動資産の合計額 | 36,412,857 | | 37,230,666 | |
| 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 | 59,264 | 5,941 | 59,664 | 5,987 |
| 3 | うち、安定預金の額 | 359 | 11 | 333 | 10 |
| 4 | うち、準安定預金の額 | 58,904 | 5,930 | 59,331 | 5,977 |
| 5 | ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額 | 11,017,072 | 8,112,622 | 10,589,566 | 7,925,393 |
| 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 | 9,892,304 | 6,987,854 | 9,410,124 | 6,745,950 |
| 8 | うち、負債性有価証券の額 | 1,124,769 | 1,124,769 | 1,179,442 | 1,179,442 |
| 9 | 有担保資金調達等に係る資金流出額 | | 259,727 | | 324,671 |
| 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 | 2,733,287 | 1,693,107 | 2,705,770 | 1,668,668 |
| 11 | うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額 | 1,445,176 | 1,445,176 | 1,418,185 | 1,418,185 |
| 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 | 1,288,111 | 247,931 | 1,287,585 | 250,483 |
| 14 | 資金提供義務に基づく資金流出額等 | 4,511,643 | 235,331 | 3,951,289 | 202,548 |
| 15 | 偶発事象に係る資金流出額 | 3,270,516 | 142,613 | 3,231,039 | 130,578 |
| 16 | 資金流出合計額 | | 10,449,341 | | 10,257,845 |
| 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 | 1,139,727 | 0 | 1,256,461 | 0 |
| 18 | 貸付金等の回収に係る資金流入額 | 4,498,245 | 3,980,188 | 3,271,300 | 2,765,442 |
| 19 | その他資金流入額 | 5,890,625 | 483,049 | 6,472,382 | 964,172 |
| 20 | 資金流入合計額 | 11,528,597 | 4,463,237 | 11,000,143 | 3,729,614 |
| 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 | | 36,412,857 | | 37,230,666 |
| 22 | 純資金流出額 | | 5,986,104 | | 6,528,231 |
| 23 | 単体流動性カバレッジ比率 | | 608.2% | | 570.3% |
| 24 | 平均値計算用データ数 | | 62 | | 62 |