

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 (2020/10-12)		前四半期 (2020/7-9)	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	28,097,281		28,855,718	
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	41,736	4,137	41,380	4,107
3	うち、安定預金の額	513	15	432	12
4	うち、準安定預金の額	41,223	4,122	40,947	4,094
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	11,257,812	8,225,272	11,015,965	7,961,814
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	10,602,686	7,570,146	10,374,791	7,320,640
8	うち、負債性有価証券の額	655,125	655,125	641,174	641,174
9	有担保資金調達等に係る資金流出額	223,197		340,834	
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	3,143,910	1,655,465	3,111,741	1,671,409
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,369,317	1,369,317	1,390,344	1,390,344
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	1,774,593	286,148	1,721,397	281,065
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	3,025,956	447,740	3,788,479	457,023
15	偶発事象に係る資金流出額	5,279,548	129,312	5,132,705	133,103
16	資金流出合計額	10,685,126		10,568,292	
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	-	-	190,529	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,473,163	1,791,776	2,647,144	1,847,297
19	その他資金流入額	3,540,081	200,675	4,149,854	408,425
20	資金流入合計額	6,013,244	1,992,451	6,987,528	2,255,723
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	28,097,281		28,855,718	
22	純資金流出額	8,692,675		8,312,569	
23	連結流動性カバレッジ比率	323.2%		347.1%	
24	平均値計算用データ数	63		61	