

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 (2023/1-3)		前四半期 (2022/10-12)	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	28,867,671		26,757,379	
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	27,457	2,713	34,200	3,388
3	うち、安定預金の額	454	13	448	13
4	うち、準安定預金の額	27,002	2,700	33,751	3,375
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	12,711,483	9,678,346	14,166,161	11,063,205
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	11,683,530	8,650,392	13,352,032	10,249,076
8	うち、負債性有価証券の額	1,027,953	1,027,953	814,128	814,128
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		135,088		63,983
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	4,411,685	2,752,694	4,310,941	2,642,159
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	2,431,419	2,431,419	2,315,587	2,315,587
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	1,980,266	321,274	1,995,353	326,571
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	2,918,809	310,038	2,539,877	130,179
15	偶発事象に係る資金流出額	7,538,092	166,308	7,660,046	170,511
16	資金流出合計額		13,045,189		14,073,427
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	31,967	712	-	-
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,383,606	1,683,785	2,421,756	1,665,365
19	その他資金流入額	3,381,785	315,915	3,070,479	396,026
20	資金流入合計額	5,797,358	2,000,413	5,492,235	2,061,391
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		28,867,671		26,757,379
22	純資金流出額		11,044,775		12,012,035
23	連結流動性カバレッジ比率		261.3%		222.7%
24	平均値計算用データ数		60		62