

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 (2019/10-12)		前四半期 (2019/7-9)	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	26,893,875		27,620,064	
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	44,647	4,438	45,265	4,499
3	うち、安定預金の額	375	11	394	12
4	うち、準安定預金の額	44,272	4,427	44,872	4,487
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	10,217,442	7,266,017	10,631,416	7,769,677
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	9,502,054	6,550,629	10,029,637	7,167,898
8	うち、負債性有価証券の額	715,388	715,388	601,779	601,779
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		134,665		179,965
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	2,760,699	1,613,424	2,634,857	1,569,616
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,358,068	1,358,068	1,319,464	1,319,464
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	1,402,631	255,356	1,315,393	250,152
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	5,141,410	584,963	5,382,511	534,157
15	偶発事象に係る資金流出額	3,667,590	176,580	3,924,058	190,991
16	資金流出合計額		9,780,088		10,248,905
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	198,195	0	10,484	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,985,938	2,274,266	4,011,735	3,069,400
19	その他資金流入額	5,253,699	612,935	5,420,977	444,254
20	資金流入合計額	8,437,832	2,887,201	9,443,196	3,513,655
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		26,893,875		27,620,064
22	純資金流出額		6,892,887		6,735,251
23	単体流動性カバレッジ比率		390.1%		410.0%
24	平均値計算用データ数		62		62