

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 (2020/7-9)		前四半期 (2020/4-6)	
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額	28,808,101		28,002,569	
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	41,380	4,107	41,693	4,143
3	うち、安定預金の額	432	12	369	11
4	うち、準安定預金の額	40,947	4,094	41,323	4,132
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	10,982,477	7,928,326	12,318,310	8,280,231
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	10,341,213	7,287,062	11,641,343	7,603,264
8	うち、負債性有価証券の額	641,264	641,264	676,966	676,966
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		340,834		353,070
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	3,055,983	1,655,401	2,893,761	1,659,417
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,390,344	1,390,344	1,413,059	1,413,059
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	1,665,639	265,057	1,480,701	246,358
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	3,789,371	457,914	3,753,409	265,668
15	偶発事象に係る資金流出額	3,454,138	114,625	3,369,311	119,040
16	資金流出合計額		10,501,210		10,681,571
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	0	159,415	0
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,694,157	1,894,818	2,504,627	1,715,873
19	その他資金流入額	4,149,159	407,729	4,318,214	515,733
20	資金流入合計額	7,033,845	2,302,548	6,982,257	2,231,606
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		28,808,101		28,002,569
22	純資金流出額		8,198,662		8,449,965
23	単体流動性カバレッジ比率		351.3%		331.3%
24	平均値計算用データ数		61		61