

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 (2020/10-12)		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	27,807,462		28,808,101	
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	11,226,534	8,193,993	10,982,477	7,928,326
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	10,571,324	7,538,784	10,341,213	7,287,062
8	うち、負債性有価証券の額	655,209	655,209	641,264	641,264
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	3,112,950	1,650,363	3,055,983	1,655,401
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	1,743,633	281,046	1,665,639	265,057
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	3,027,148	448,932	3,789,371	457,914
15	偶発事象に係る資金流出額	3,509,532	106,481	3,454,138	114,625
16	資金流出合計額		10,627,107		10,501,210
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	2,534,739	1,853,631	2,694,157	1,894,818
19	その他資金流入額	3,545,163	200,072	4,149,159	407,729
20	資金流入合計額	6,079,902	2,053,703	7,033,845	2,302,548
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		27,807,462		28,808,101
22	純資金流出額		8,573,404		8,198,662
23	単体流動性カバレッジ比率		324.3%		351.3%
24	平均値計算用データ数		63		61